

## عنوان مقاله:

تعیین نرخ تبدیل ارز واقعی در اقتصاد ایران ب استفاده از آزمون هم انباشتگی یوهانسن و تابع پاسخ ضربه ای

## محل انتشار:

اولین همایش بین المللی اقتصاد سنجی، روشها و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

## نویسندگان:

مرتضی صالحی سربیزن - کارشناس ارشد برنامه ریزی سیستم های اقتصادی دانشگاه صنعتی اصفهان

میلاد همتیان - دانشجوی کارشناسی ارشد صنایع دانشگاه صنعتی اصفهان

فریماه مخاطب رفیعی - دکترای صنایع دانشگاه صنعتی اصفهان

## خلاصه مقاله:

نرخ تبدیل ارز واقعی نقش مهمی در مبادله بین المللی و تعیین سرمایه گذاری ایفا می کند. کاهش نرخ تبدیل ارز واقعی، صادرات و درآمدهای حاصل از سرمایه گذاری مستقیم خارجی را آهسته کرده و بنابراین رشد اقتصادی نیز تحت تأثیر قرار می گیرد. در تعیین نرخ تبدیل ارز واقعی در بلند مدت گوناگونی بهره وری، نوع تجارت، قیمت واقعی نفت و گوناگونی ارزش افزوده مهم می باشند. در این مطالعه به بررسی تعیین نرخ تبدیل ارز واقعی در اقتصاد ایران پرداخته می شود. پارامترهای مؤثر در تعیین نرخ تبدیل ارز واقعی مقادیر تجارت باز برای ایران محاسبه، سپس ساکن پذیری متغیرها و نهایتاً از تست هم انباشتگی یوهانسن و برای بررسی اثرات هر یک از متغیرها از تابع پاسخ ضربه برای دوره ی زمانی 1980-2008 استفاده می شود. نتایج تجزیه های واریانس خطا پیش بینی کل نشان می دهد که گوناگونی بهره وری و گوناگونی ارزش افزوده در تعیین نرخ تبدیل ارز واقعی در ایران مهم هستند. اما اثرات این متغیرها در تعیین نرخ تبدیل ارز واقعی متفاوت است.

## کلمات کلیدی:

ارز واقعی، تجارت باز، اقتصاد ایران، هم انباشتگی، یوهانسن، تابع پاسخ ضربه ای

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176227>

