

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر متغیرهای کلان اقتصادی بر نرخ ارز با رویکرد پویایی های سیستم

محل انتشار:

پژوهشنامه اقتصاد کلان، دوره 15، شماره 29 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 37

نویسندگان:

محمدهادی دمیری - دانشجوی دکتری گروه مدیریت مالی، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران

پرویز سعیدی - نویسنده مسئول دانشیارگروه حسابداری و مدیریت، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران

حسین دیده خانی - استادیارگروه مهندسی مالی، واحد علی آباد کتول، دانشگاه آزاد اسلامی، علی آباد کتول، ایران

ابراهیم عباسی - دانشیار گروه مدیریت، دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی، دانشگاه الزهرا (س)، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

هدف از پژوهش حاضر، تحلیل حساسیت روند و قیمت نرخ ارز نسبت به عوامل اساسی موثر بر آن است. به منظور تحلیل حساسیت نرخ ارز، ابتدا روند تغییرات نرخ ارز با استفاده از روش پویایی های سیستم برای دوره زمانی ۱۳۸۳ تا ۱۴۰۱ پیش بینی شده و سپس، تاثیر تغییرات عواملی همچون بهره وری، پایه پولی، سهم هزینه های عمرانی دولت، تحریم ها و نرخ بهره بر نرخ ارز مورد ارزیابی قرار گرفته است. بدین صورت که ابتدا تاثیر تغییر هر یک از متغیرها به صورت مجزا بر روند نرخ ارز مورد ارزیابی قرار گرفت و سپس تاثیر تغییر متغیرهای فوق به صورت همزمان، بر روند نرخ ارز بررسی شد. نتایج به دست آمده نشان می دهد افزایش یا کاهش هر یک از این متغیرها (بهره وری، تحریم، هزینه های عمرانی دولت، نرخ بهره و پایه پولی) با فرض ثابت بودن سایر عوامل، نرخ ارز را تحت تاثیر قرار می دهد. همچنین نتایج حاکی از آن است که تغییرات همزمان چند متغیر، نرخ ارز را بیشتر از تغییر صرفا یک متغیر تحت تاثیر قرار می دهد.

کلمات کلیدی:

تحلیل حساسیت، نرخ ارز، روش شناسی پویایی های سیستم، عوامل موثر بر نرخ ارز

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1852625>

