

عنوان مقاله:

تاثیر نا اطمینانی تورم بر نرخ ارز در ایران

محل انتشار:

اولین کنفرانس اقتصاد و مدیریت کاربردی با رویکرد ملی (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

عباسعلی ابونوری - عضو هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکزی

محمد توکلیان - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکزی

خلاصه مقاله:

پدیده تورم بویژه در نرخهای بالا به طور مستقیم و غیر مستقیم، هزینه زیادی را بر جامعه تحمیل می نماید. همچنین پیامدهای سوء از نا اطمینانی تورم ناشی می شود. در این ارتباط سوالات زیر مطرح است: تورم و نا اطمینانی تورم بر نرخ ارز چه تاثیری دارد؟ آیا نا اطمینانی تورم بر نوسانات نرخ ارز تاثیر گذار است؟ مطالعه حاضر، تاثیرات تورم بر نرخ ارز در ایران در دوره 91-1371 را با در نظر گرفتن نا اطمینانی تورم مورد بررسی قرار داده است. مدل‌های مورد استفاده در این تحقیق، الگوی واریانس ناهمسانی شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته متقارن (EGARCH) جهت برآورد نا اطمینانی تورم می باشد و همچنین مدل خودرگرسیوبرداری (VAR) جهت بررسی ارتباط بین متغیرها می باشد. در ادامه به منظور تحلیل رابطه بین متغیرهای مورد بررسی از تحلیل توابع عکس العمل آنی و تجزیه واریانس که دارای استفاده فراوانی در مدل های VAR می باشد استفاده شده است. کلیه متغیرها ماهیانه یا سالیانه بر حسب ریال محاسبه شد و آمار و اطلاعات از مرکز آمار ایران و بانک مرکزی ایران جمع آوری گردید. لذا نتایج حاکی از آن است رابطه دو سویه بین تورم و نرخ ارز برقرار بوده و با افزایش تورم، نا اطمینانی تورم افزایش یافته و موجب نوسانات نرخ ارز در کوتاه مدت می گردد که این نوسانات خود اثر تورم زایی دارد.

کلمات کلیدی:

نا اطمینانی تورم، نرخ ارز، مدل واریانس ناهمسانی شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته متقارن (EGARCH)، مدل خودرگرسیو برداری (VAR)

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/289999>

