

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر نااطمینانی نرخ ارز بر رشد اقتصادی ایران با استفاده از شبکه های عصبی

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 4، شماره 15 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

مجتبی کاظمی - دانشجوی دکتری دانشگاه یزد نویسنده مسئول

سیدعبدالمجید جلائی اسفندآبادی - دانشیار دانشگاه شهید باهنر کرمان

حسین اکبری فرد - استادیار دانشگاه شهید باهنر کرمان

خلاصه مقاله:

در این تحقیق سعی شده است که بطور تجربی به بررسی و پیش بینی تاثیر نااطمینانی نرخ ارز بر رشد اقتصادی ایران برای دوره 89-1338 با استفاده از روش شبکه های عصبی مصنوعی پرداخته شود برای این منظور در ابتدا نااطمینانی نرخ ارز با بکارگیری الگوی واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو تعمیم یافته GARCH محاسبه شده است سپس تاثیر این نااطمینانی در نرخ ارز بر رشد اقتصادی ایران با توجه به شبکه های عصبی مصنوعی مورد آزمون قرار گرفته است برای این مهم نخست شبکه مناسب از نظر معیارهای ارزیابی همچون ضریب تعیین و میانگین مربعات خطا تعیین و سپس با توجه به شبکه آموزش دیده به بررسی فرضیه تحقیق پرداخته شد نتایج نشان میدهد که نااطمینانی نرخ ارز تاثیر منفی اما خفیف روی رشد اقتصادی ایران در طی سالهای اخیر داشته است اما انتظارات بر آن است که این تاثیر در سالهای آتی از معناداری بالاتری برخوردار باشد

کلمات کلیدی:

نااطمینانی / نرخ ارز / الگوی GARCH / رشد اقتصادی ایران / شبکه عصبی مصنوعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/405417>

