

## عنوان مقاله:

بررسی اثرات نامتقارن نوسانات نرخ ارز بر تورم در ایران

## محل انتشار:

اولین همایش ملی پژوهش های کاربردی حسابداری، مدیریت اقتصاد (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 25

## نویسندگان:

حسن حیدری - دانشیار دانشکده اقتصاد و مدیریت دانشگاه ارومیه گروه اقتصاد ارومیه ایران

الهام عبدیلی - کارشناس ارشد دانشکده اقتصاد و مدیریت ارومیه گروه اقتصاد ارومیه ایران

## خلاصه مقاله:

هدف اصلی این مقاله بررسی اثرات نامتقارن نوسانات نرخ ارز بر تورم در کشور ایران طی دوره زمانی 1389-1369 میباشد از این رو ابتدا با استفاده از رهیافت VECH مدل گارچ دو متغیره به بررسی اثرات سرریزشوکها و نوسانات نرخ ارز بر تورم پرداخته است. با استفاده از روش باکس - چینیز برای نرخ ارز و استخراج نوسانات آن فرضیه وجود نامتقارن نوسانات آن بر تورم با استفاده از مدل GARCH تک متغیره مورد بررسی قرار می گیرد. نتایج مورد بررسی وجود اثرات نامتقارن را مورد تایید قرار میدهد.

## کلمات کلیدی:

نوسانات نرخ ارز؛ اثرات نامتقارن؛ تورم

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/450176>

