

عنوان مقاله:

تاثیر شوک نرخ ارز بر متغیرهای منتخب بازارهای مالی با تاکید بر صنعت بیمه. دوره ی 1380 تا 1390

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی علوم انسانی با رویکرد بومی - اسلامی و با تاکید بر پژوهش های نوین (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

ایمان گرجیان - دانشجوی کارشناسی ارشد مدیریت مالی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد یاسوج

اسماعیل شمس الدین - عضو هیات علمی دانشگاه آزاد اسلامی واحد یاسوج

خلاصه مقاله:

یکی از مهمترین عوامل تاثیرگذار بر نوسانات تولید نوسانات نرخ واقعی ارز است. نظامهای ارزی در سطح بینالملل طی سالیان متمادی با فراز و نشیبهای زیادی روبرو بوده و ساختار اقتصادی کشورها را تحت تاثیر قرار داده است. نظامهای ارزی مختلف چگونگی تعیین نرخ ارز را در اقتصاد نشان میدهد. نرخ ارز در طول سالیان متمادی خصوصا بعد از فروپاشی سیستم نرخ ارز ثابت (نظام برتن وودز) فراربت بسیاری داشت. از همان زمان اثر فراربت نرخ ارز بر اقتصاد کانون توجه طرفداران دو سیستم نرخ ارز ثابت و شناور بوده است. بنابراین با توجه به این که بازار ارز در ایران در طول تقریبا چهار دهه گذشته بسیار پرنوسان بوده است، شناخت نحوه و شدت تاثیرگذاری تکانههای ارزی بر اقتصاد ایران حایز اهمیت است. در این راستا این مطالعه به بررسی تاثیر شوک نرخ ارز بر بازارهای مالی با تاکید بر صنعت بیمه در ایران بر اساس اطلاعات فصلی طی دوره 4-1390(1)-1380 پرداخته است. به این منظور ابتدا شاخص نااطمینانی ناشی از شوک نرخ ارز از طریق فیلتر هودریک پرسکات برآورد، سپس روابط متقابل متغیرهای مدل با استفاده از الگوی خودتوضیح برداری طی دو ابزار توابع واکنش آنی و تجزیه واریانس بررسی و در ادامه رابطه بلندمدت بین متغیرها نیز با استفاده از تکنیک همانباشتگی یوهانسن- جوسیلیوس استخراج شده است. دادههای تحقیق نیز از مراکز مختلف آماری استخراج و به صورت حقیقی مورد استفاده قرار گرفت. نتایج تخمین نشان میدهد که درکوتاه مدت و بلندمدت، شوک نرخ ارز بر متغیرهای مورد مطالعه اثرگذار میباشد

کلمات کلیدی:

بازار مالی، شوک نرخ ارز، صنعت بیمه، الگوی خودرگرسیون برداری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/650063>

