

عنوان مقاله:

بررسی عوامل تعیین کننده نرخ ارز موثر واقعی در ایران با استفاده از رگرسیون فازی

محل انتشار:

فصلنامه نظریه های کاربردی اقتصاد، دوره 1، شماره 3 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

نویسندگان:

حسین اصغریور - دانشیار گروه اقتصاد دانشگاه تبریز

علی مهدیلو - دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس

سیدمیثم اسماعیلی - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه ارومیه

خلاصه مقاله:

نرخ ارز نقش اساسی در تعیین درجه رقابت بین المللی و وضعیت اقتصاد داخلی دارد، لذا شناسایی عوامل موثر بر آن می تواند در سیاست گذاری های تجاری مفید باشد. با این وجود اثر متغیرها بر نرخ ارز اغلب با ابهام و ناطمینانی همراه است. لذا استفاده از رگرسیون فازی برای تخمین اثر این متغیرها بر نرخ ارز می تواند مفید باشد. زیرا رگرسیون فازی بازده ای از مقادیر ممکن را برای ضرایب تخمین می زند، در حالی که رگرسیون کلاسیک تنها یک مقدار مشخص باری ضرایب محاسبه می کند. هدف این پژوهش تعیین عوامل موثر بر نرخ ارز موثر واقعی با استفاده از رگرسیون فازی در ایران و در دوره 1381 تا 1389 است. در این راستا، از رشد بهره وری، مخارج دولت، سیاست های تجاری، قیمت نفت و اسکناس و مسکوک در دست مردم به عنوان عوامل موثر بر نرخ ارز استفاده شده است. بر اساس یافته ها تاثیر مخارج دولت و نرخ رشد بهره وری مثبت و اثر قیمت نفت، اسکناس و مسکوکات در دست مردم و سیاست های تجاری منفی است. همچنین اثر اسکناس و مسکوکات و قیمت نفت مبهم است. از این رو از ضراب بازه ای برای تخمین اثرگذاری آنها استفاده شده است.

کلمات کلیدی:

نرخ ارز موثر حقیقی، منطق فازی، آزمون هم انباشتگی، رگرسیون فازی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/703593>

