

## عنوان مقاله:

اثر نرخ ارز و نااطمینانی نرخ ارز بر مصرف داخلی در ایران

## محل انتشار:

فصلنامه نظریه های کاربردی اقتصاد، دوره 4، شماره 3 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

## نویسندگان:

سیدجمال الدین محسنی زنوزی - استادیار اقتصاد دانشگاه ارومیه

سلیمان فیضی ینگجه - فیضی ینگجه استادیار اقتصاد دانشگاه ارومیه

اکرم موسوی - کارشناس ارشد اقتصاد دانشگاه ارومیه

## خلاصه مقاله:

هدف اصلی این تحقیق بررسی تاثیر نرخ ارز و نااطمینانی نرخ ارز بر مصرف داخلی در اقتصاد ایران برای دوره زمانی 1367-1393 به صورت فصلی است. بدین منظور، از مدل واریانس ناهمسانی شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته یا همان گارچ (GARCH) برای اندازه گیری نااطمینانی نرخ ارز و از رهیافت آزمون کرانه ها در مدل خودرگرسیونی با وقفه های توزیعی (ARDL) برای بررسی روابط بلندمدت و نیز الگوی تصحیح خطای برداری برای بررسی انحراف کوتاه مدت متغیرها از مقادیر تعادلی خود استفاده شده است. نتایج تحقیق حاکی از آن است که تاثیر نرخ ارز بر مصرف مثبت و معنادار و اثر نااطمینانی نرخ ارز بر مصرف منفی معنادار است. رابطه مثبت میان نرخ ارز و مصرف، موافق با نظریه گذر ارز می باشد. رابطه منفی بین نااطمینانی نرخ ارز و مصرف موافق با نظریه جذب می باشد. نتیجه این تحقیق، اتخاذ سیاست مناسب ارزی در جهت کاهش نااطمینانی نرخ ارز را به مسیولان پولی کشور پیشنهاد می کند. همچنین با توجه به معنادار نبودن تاثیر مخارج دولت بر مصرف در کوتاه مدت و معنادار بودن تاثیر مخارج دولت بر مصرف در میان مدت و بلندمدت پیشنهاد می شود نرخ کنترل شده مخارج دولت در برنامه میان مدت پیروی شود.

## کلمات کلیدی:

مصرف کل، نرخ ارز، نااطمینانی نرخ ارز، مدل گارچ (GARCH)، مدل خودرگرسیونی با وقفه های توزیعی (ARDL)

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/703684>

