

عنوان مقاله:

بررسی رابطه بلند مدت بین نرخ ارز حقیقی و درآمدهای نفتی با استفاده از الگوی ARDL

محل انتشار:

اولین کنفرانس ملی مدیریت و سیستم های فازی (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

نویسندگان:

رامین آذری - دانشجوی ریاضیات مالی، واحد تهران مرکز، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

فرزین اربابی - استادیار گروه اقتصاد بازرگانی و حمل و نقل، واحد تهران مرکز، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

مجید امیرفخریان - استاد تمام ریاضی، واحد تهران مرکز، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

بررسی عوامل موثر بر نرخ ارز حقیقی به عنوان یکی از مهم ترین متغیرهای اقتصادی دارای اهمیت زیادی است. کاهش نرخ ارز موجب تقویت ارزش پول ملی می شود و هنگامی که ارزش پول یک کشور افزایش می یابد، قیمت کالاهای کشور در خارج گران تر و قیمت کالاهای خارجی در داخل ارزان تر می شود و توان رقابتی کشور در بازارهای جهانی کاهش می یابد. در کشورهای صادرکننده نفت مانند ایران که متکی به درآمدهای نفتی هستند یکی از عوامل مهمی که می تواند بر نرخ ارز حقیقی تاثیر بگذارد نوسانات قیمت نفت است، در این تحقیق رابطه بین نرخ ارز حقیقی و درآمدهای نفتی، نرخ بهره وری و تولید ناخالص داخلی طی دوره زمانی سالانه 1359-1393 مورد بررسی قرار گرفته است. در تحقیق حاضر از روش خود توضیح با وقفه های گسترده ARDL استفاده کرده ایم و برای برآورد آن نرم افزار Eviews9 به کار گرفته شده است. نتایج برآورد به ما نشان می دهد که درآمدهای نفتی و تولید ناخالص داخلی بر نرخ ارز حقیقی تاثیر منفی دارند و نرخ بهره وری بر نرخ ارز حقیقی تاثیر مثبت دارد

کلمات کلیدی:

ریاضیات مالی، نرخ ارز حقیقی، بیماری هلندی، درآمدهای نفتی، الگوی ARDL

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/741357>

