

عنوان مقاله:

بررسی اثر نااطمینانی نرخ ارز بر تراز تجاری بخش کشاورزی ایران کاربرد الگوهای TGARCH، EGARCH، GARCH

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد کشاورزی، دوره 8، شماره 2 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

نویسندگان:

مهدی خسروی - دانشجوی دکتری گروه اقتصاد کشاورزی دانشگاه شهید باهنر کرمان

رضا محسنی - عضو هیئت علمی دانشکده علوم اقتصادی و سیاسی دانشگاه شهید بهشتی

خلاصه مقاله:

نوسان نرخ ارز و در پی آن نوسان قیمت‌های نسبی، با ناپایدار کردن شرایط اقتصادی و افزایش تورم موجب افزایش نااطمینانی در عرصه تجارت خارجی میشود، که از پیامدهای آن میتوان به کاهش حجم تجارت، سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و رشد اقتصادی اشاره کرد. در این پژوهش به منظور ارزیابی اثر نااطمینانی نرخ ارز بر تراز تجاری بخش کشاورزی ایران نخست معادله رفتاری نرخ ارز با الگوهای ARMA تبیین و آنگاه با انجام آزمون و اطمینان از نامتقارن بودن اثر شوکهای ارزی، شاخص نااطمینانی نرخ ارز از الگوی TGARCH استخراج شد. پس از آن اثر نااطمینانی نرخ ارز بر تراز تجاری بخش کشاورزی ایران با استفاده از الگوی جوهانسون-جوسیلیوس (VECM) و داده های دوره زمانی 1362-1390 برآورد شد. نتایج نشان میدهد که ضریب شاخص نااطمینانی نرخ ارز (-0/14)، منفی و از لحاظ آماری معنیدار میباشد. لذا افزایش نوسان نرخ ارز در بلندمدت، وخامت تراز تجاری بخش کشاورزی ایران را در پی خواهد داشت. علاوه بر این افزایش درآمد ناخالص شریکان تجاری ایران و نرخ ارز حقیقی، موجب بهبود، و در مقابل افزایش درآمد ناخالص داخلی ایران، موجب کاهش تراز تجاری در بلند مدت میشود. بنابر نتایج الگوی تصحیح خطا، نااطمینانی نرخ ارز در کوتاهمدت نیز وخامت تراز تجاری بخش کشاورزی را به دنبال دارد. اثر کوتاهمدت دیگر متغیرها بر تراز تجاری همانند اثر بلندمدت آنها است. همچنان ضریب (-0/39) ECM نشان میدهد که در هر دوره 39 درصد شوکهای وارده در کوتاهمدت به سمت مقادیر تعادلی بلندمدت تعدیل مییابد.

کلمات کلیدی:

الگوی VECM، تراز تجاری بخش کشاورزی، شوک های نامتقارن، نااطمینانی نرخ ارز

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/763257>

