

عنوان مقاله:

بررسی تاثیر نرخ نوسانات ارز بر تولید ناخالص داخلی

محل انتشار:

کنفرانس ملی پژوهشهای نوین حسابداری و مدیریت در هزاره سوم (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

محمد حسین دلشاد - دانشگاه آزاد اسلامی واحد میبد

حسینعلی امینی خواه - دانشگاه آزاد اسلامی واحد میبد

خلاصه مقاله:

هدف این مطالعه بررسی تاثیر عدم اطمینان حاصل از نوسانات نرخ ارز بر تولید ناخالص داخلی می باشد. این تحقیق از نظر روش مطالعه توصیفی همبستگی است و از نظر روش گردآوری کتابخانه ای و میدانی است و از مصاحبه و مشاهده داده های آماری و شبکه های کامپیوتری و اینترنت برای این تحقیق استفاده شده است جامعه آماری در این پژوهش سرمایه گذاران بانک ها، موسسات و سازمان های فعال در حوزه سرمایه گذاری می باشد و برای نمونه از داده های سری زمانی در 36 کشور ارزیابی می شود و کاربرد روش ارزیابی محدوده برای نشان دادن نوسانات نرخ ارز بر سرمایه گذاری داخلی در 36 کشور بررسی می شود برای این کار از داده های آماری سال 1389-1394 استفاده می شود. در این تحقیق جهت داده های آماری از سازمان سرمایه گذاری، بانک مرکزی، دفتر اقتصاد کلان سازمان مدیریت و برنامه ریزی استفاده می شود. برای تجزیه تحلیل از نرم افزار Eviews6 استفاده می شود از آنجا که در بررسی اثر نوسانات نرخ ارز بر تولید ناخالص داخلی ابتدا باید الگوی ناطمینانی نرخ ارز واقعی محاسبه شود به همین دلیل نخست الگوی مربوط به ناطمینانی نرخ ارز واقعی بررسی شده و سپس الگوی مربوط به سرمایه گذاری خصوصی بررسی می شود. برای الگوی ناطمینانی نرخ ارز واقعی از مدل های GARCH و همچنین روش باکس جنکینز استفاده می شود و واریانس ها پیش بینی می شوند. سپس از آزمون شکست ساختاری پرن و آزمون آرچ استفاده شده و رگرسیون نیز بدست می آید. از الگوی شتاب انعطاف پذیر نیز برای رفتار تولید ناخالص داخلی استفاده می شود. سپس برای اقتصاد سنجی تابع سرمایه گذاری داخلی از الگوی خود بازگشت با وقفه های توزیع شونده استفاده می شود. در آخر نیز از الگوی تصحیح خطا نوسانات کوتاه مدت متغیرها استفاده می شود. و در انتها نتایج فرضیات نشان داد بین نوسانات نرخ ارز و تولید ناخالص داخلی رابطه معنی داری وجود دارد.

کلمات کلیدی:

نوسانات، نرخ ارز، تولید ناخالص داخلی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/742755>

