

دانشگاه الزهرا

دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی

پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته رشته برنامه ریزی و توسعه اقتصادی

موضوع:

اثر نا اطمینانی ارز بر تجارت ایران

استاد راهنما: جناب آقای دکتر سید جواد پورمقیم

استاد مشاور: سرکار خانم دکتر زهرا افشاری

تحقیق و نگارش: فاطمه نعمت اللهی

بهمن ماه ۱۳۷۵

چکیده:

اثر نا اطمینانی نرخ ارز بر تجارت ایران توسط فاطمه نعمت اللهی در این تحقیق پس از بررسی مبانی تئوریک موجود و مطالعات تجربی گذشته پیرامون موضوع، یک الگو برای تقاضای واردات و صادرات در نظر گرفته خواهد شد، سپس پارامترهای آن با استفاده از داده های سری زمانی فصلی موجود در کشور با به کارگیری برآورد گر حداقل مربعات تخمین زده می شود. نتایج این قسمت حاکی از اثر مثبت ریسک نرخ ارز بر واردات، صادرات و (اثر بر واردات کمتر از صادرات) و مازاد تجاری است.

سپس اثرات ۳۰ درصد تغییر در ریسک نرخ ارز بر صادرات، واردات و در نتیجه ذخائر ارزی به روش گاس - سایدل شبیه سازی خواهد گردید. نتایج نشان می دهد که افزایش ریسک نرخ ارز هم برای صادر کننده و هم برای وارد کننده اثر مثبت بر صادرات و ذخائر ارزی و اثر منفی بر واردات دارد.

فهرست مطالب

فهرست جداول

فهرست نمودارها

مقدمه

فصل اول - بررسی تئوریکی موضوع و نظریه ها

۱-۱ مقدمه

۲-۱ بازار ارز

۱-۲-۱ نرخ ارز

۲-۲-۱ تعادل نرخ ارز

۳-۲-۱ نقش نرخ ارز در تعدیل حسابهای جاری

۳-۱ نرخ ارز انعطاف پذیر

۱-۳-۱ فروش تامینی

۲-۳-۱ آربیتراژ با بهره

۳-۳-۱ سفته بازی (اسپکیولاسیون)

۴-۱ نرخ ارز ثابت

۱-۴-۱ عدم اطمینان کمتر

۲-۴-۱ سفته بازی با ثبات

۳-۴-۱ تورم و کنترل قیمت ها

۵-۱ نا اطمینانی نرخ ارز

۱-۵-۱ بنیان ها و نا اطمینانی نرخ ارز

۲-۵-۱ فروش تامینی و نا اطمینانی

۳-۵-۱ اثرات نرخ ارز بر تجارت و نا اطمینانی

۴-۵-۱ اندازه گیری نا اطمینانی نرخ ارز

۶-۱ نرخ ارز موثر و شاخصهای آن

فصل دوم - مروری بر مطالعات انجام شده

فصل سوم - برآورد عملی مدل و روش تحقیق

مقدمه

۱-۳ مدل مورد بررسی

۱-۱-۳ تابع تقاضای واردات

۲-۱-۳ تابع صادرات

۳-۱-۳ مدل با وقفه های توزیع شده

۲-۳ روش تحقیق

۳-۳ برآورد عملی مدل

۱-۳-۳ اطلاعات آماری

۲-۳-۳ نتایج حاصل از برآورد تقاضای واردات

۳-۳-۳ نتایج حاصل از برآورد صادرات

۴-۳-۳ نتایج حاصل از ورود وقفه های توزیع شده

۵-۳-۳ آزمون خود همبستگی پیاپی جملات اختلال

۶-۳-۳ آزمون واریانس هاهمستنی مشروط یا ARCH

۷-۳-۳ آزمون نرمالیتی NORMALITY

۴-۳ شبیه سازی الگو

فصل چهارم - خلاصه نتیجه گیری و پیشنهاد

منابع و مأخذ