

مبانی عبور نرخ ارز
همراه با برآورد الگوی
کاربردی

www.ketab.ir

مؤلف:

وحید حاجی حتم‌لو





غالب سنہ ۱۲۸۵ء

سرشناسه	:	حاجی حتم‌لو، وحید، ۱۳۵۸-
عنوان و نام پدیدآور	:	مبانی عبور نرخ ارز همراه با برآورد الگوی کاربردی / مولف وحید حاجی حتم‌لو.
مشخصات نشر	:	تهران: نورا، ۱۴۰۰.
مشخصات ظاهری	:	۱۰۸ص: ۱۴/۵ × ۲۱/۵ س.م.
شابک	:	۳۰۰۰۰ ریال: ۵-۷۳-۶۶۴۵-۶۰۰-۹۷۸
وضعیت فهرست نویسی	:	فیفا
موضوع	:	ارز -- نرخ‌ها
موضوع	:	Foreign exchange rates
موضوع	:	ارز -- ایران -- نرخ‌ها
موضوع	:	Foreign exchange rate -- Iran
موضوع	:	ارز -- ایران -- نرخ‌ها -- الگوهای اقتصادسنجی
موضوع	:	Foreign exchange rates -- Iran -- Econometric models
رده بندی کنگره	:	۳۸۵۲HG
رده بندی دیویی	:	۴۵۶۲/۳۲۲
شماره کتابشناسی ملی	:	۸۴۱۲۴۴۱
اطلاعات رکورد کتابشناسی	:	فیفا

عنوان: مبانی عبور کلاغ از هزاره با برآورد الگوی کاربردی

مؤلف: ومید حاجی مکم لو

ناشر: نورا

نوبت چاپ: اول ۱۴۰۰

شمارگان: ۵۰۰ نسخه

قیمت: ۴۰۰۰۰ تومان

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۶۶۴۵-۷۳-۵

مرکز نشر: میدان انقلاب، خیابان منیری جاوید، جنب بازارچه کتاب، بن بست

مبین پلاک ۲ تلفن: ۶۶۴۰۳۷۱۷

پست الکترونیکی

nashrenoora@gmail.com

سایت انتشارات

www.nashrenoora.ir

«کلیه حقوق برای ناشر محفوظ است»

فهرست مطالب

پیشگفتار.....	۹
---------------	---

فصل اول: عبور نرخ ارز

مقدمه.....	۱۳
نرخ ارز و انواع آن.....	۱۷
عبور نرخ ارز.....	۲۱
عبور نرخ ارز کامل و ناقص.....	۲۶
مطالعات عبور نرخ ارز.....	۳۰

فصل دوم: متغیرهای اثرگذار بر عبور نرخ ارز

مقدمه.....	۳۹
نرخ ارز و قیمت کالاهای وارداتی.....	۴۱
عبور نرخ ارز و تورم.....	۵۷
عبور نرخ ارز و درجه باز بودن اقتصاد.....	۶۷

فصل سوم: برآورد الگوی کاربردی

مقدمه.....	۷۳
معرفی الگو.....	۷۵
آزمون ساکن پذیری.....	۷۷
آزمون ساکن پذیری با وجود شکست ساختاری.....	۸۱
برآورد روابط بلند مدت بین متغیرهای الگو با استفاده از روش هم جمعی یوهانسن.....	۸۳

- تعیین وقفه بهینه ۸۳
- تعیین تعداد بردارهای هم جمعی ۸۴
- برآورد رابطه کوتاه مدت بین متغیرها با استفاده از الگوی تصحیح خطای برداری ۸۷
- برآورد الگو غیر خطی ۸۸
- برآورد پارامتر آستانه ۸۸
- نتایج ۹۰
- منابع و مآخذ ۹۲

پیشگفتار

نرخ ارز، از متغیرهای مهم اقتصاد کلان است و به طور مستقیم و غیر مستقیم بر بخش‌های خارجی و داخلی کشور اثر می‌گذارد. در پژوهش‌های اقتصادی، شناسایی وضعیت عبور نرخ ارز از اهمیت ویژه‌ای برخوردار است و میزان تأثیرپذیری حجم تجارت از ارزش پول ملی را نشان می‌دهد که با تعیین درجه عبور ارز، نحوه تأثیرپذیری شاخص قیمت کالاهای وارداتی مشخص شده و به سیاست‌گذاران اقتصادی، کمک می‌شود تا سیاست مناسبی را اتخاذ نمایند.

با عنایت به محدود بودن مطالعات صورت گرفته در زمینه «نرخ عبور ارز»، در کتاب حاضر با پرداختن به مفاهیم، مبانی و برآورد الگوی کاربردی؛ تلاش کردیم، کمک اندکی در راستای تقویت و غنای مطالب داشته باشیم و امید است این مجموعه بتواند در راستای حل مسائل و

مشکلات اقتصادی برای دانشجویان و محققان آتی، مفید و مورد استفاده قرار گیرد.

در پایان از همه عزیزانی که در مراحل مختلف تهیه، تدوین و چاپ کتاب از همفکری و همکاری آنها برخوردار بوده‌ام سپاسگزاری نموده و موفقیت روزافزونشان را آرزو مندَم.

وحید حاجی حتم لو

بهار ۱۴۰۰

www.ketab.ir