

بِسْمِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

بازار ارز و الگوهای اقتصاد سنجی

تعیین نرخ ارز

نویسندگان:

Richard Baillie - Patrick McMahon

مترجمان:

دکتر مهدی تقوی

عضو هیئت علمی دانشگاه علامه طباطبائی

دکتر بیتا شایگانی

عضو هیئت علمی دانشگاه پیام نور

دکتر فرهاد غفاری

عضو هیئت علمی واحد علوم تحقیقات دانشگاه آزاد اسلامی

سرشناسه	: بیللی، ریچارد تی.
عنوان و نام پدیدآور	Baillie, Richard (Richard T) : بازار ارز و الگوهای اقتصادسنجی تعیین نرخ ارز / [نویسندگان ریچارد بیللی، پاتریک مک ماهون]؛ مترجمان مهدی تقوی، بیتا شایگانی، فرهاد غفاری.
مشخصات نشر	: تهران : کتابخانه فروردین، ۱۳۹۲.
مشخصات ظاهری	: مصور، جدول (بخشی رنگی)
شابک	: 978-964-6693-34-0
وضعیت فهرست نویسی	: فیپا
یادداشت	: عنوان اصلی: The foreign exchange market: theory and econometric evidence, 1989.
موضوع	: بازار ارز - الگوهای اقتصادسنجی
شناسه افزوده	: مک ماهون، پاتریک سی.
شناسه افزوده	McMahon, Patrice C.
شناسه افزوده	: تقوی، مهدی، ۱۳۲۴ - مترجم
شناسه افزوده	: شایگانی، بیتا، ۱۳۵۲ - مترجم
شناسه افزوده	: غفاری، فرهاد، مترجم
رده بندی کنگره	: ۱۳۹۱ ب ۹ / HG ۲۸۲۳
رده بندی دیویی	: ۳۳۲/۲۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۳۱۱۲۳۰

انتشارات کتابخانه فروردین

نام کتاب: بازار ارز و الگوهای اقتصادسنجی تعیین نرخ ارز

نویسندگان

Richard Baillie - Patrick McMahon

مترجمان: دکتر مهدی تقوی - دکتر بیتا شایگانی - دکتر فرهاد غفاری

ناشر: کتابخانه فروردین

صفحه آرای: توکلی ۶۶۹۶۶۹۷

نوبت چاپ: چاپ اول ۱۳۹۲

تیراژ: ۱۰۰۰ نسخه

چاپ و صحافی: طیف نگار

شابک: ۹۷۸-۹۶۴-۶۶۹۳-۳۴-۰

بهاء: ۱۸۰۰۰۰ ریال

کلیه حقوق برای ناشر محفوظ می باشد. هرگونه استفاده به هر شکل بدون اجازه کتبی ناشر ممنوع است. متخلفان به موجب قانون حمایت از حقوق مؤلفان، مصنفان و هنرمندان تحت پیگرد قانونی قرار خواهند گرفت.

آدرس مرکز پخش: تهران خیابان انقلاب - خیابان فخر رازی - کوچه الوندی - پلاک ۲ - زنگ اول

تلفن: ۶۶۴۱۹۵۵۳ - ۶۶۴۹۰۰۸۱

فهرست

۵	فصل اول - مفاهیم نرخ ارز، توسعه و نهادهای تاریخی
۵	۱-۱ مقدمه
۱۱	۲-۱ نظام پولی بین‌المللی بعد از سقوط برتون وودز
۱۵	۳-۱ بحث تاریخی در مورد مشاور ساختن نرخ ارز
۲۱	۴-۱ مفاهیم نرخ ارز
۲۳	۵-۱ نظریه برابری قدرت خرید و نرخ‌های ارز واقعی
۲۶	۶-۱ رفتار اخیر نرخ ارز
۲۷	ضمیمه - توصیف نموداری رفتارهای اخیر نرخ ارز
۴۷	فصل دوم - نظریه بازارهای کارآ
۴۷	۲-۱ مقدمه
۴۸	۲-۲ تعاریف متفاوت از کارایی
۵۳	۳-۲ الگوهای مارتینگیل، زیر مارتینگیل و گشت تصادفی
۵۹	۲-۴ مشکلات عملی با مفهوم یک بازار کارآ
۶۵	۲-۵ در نظر گرفتن ریسک یا مخاطره
۷۵	فصل سوم - الگوهای نظری رفتار نرخ ارز
۷۵	۳-۱ مقدمه
۷۷	۳-۲ برابری قدرت خرید
۸۶	۳-۳ الگوی پولی
۹۰	۳-۴ الگوی پولی با قیمت چسبده دورنبوش
۹۶	۳-۵ مدل تراز سبد دارایی
۱۰۰	۳-۶ دیگر اسکان مختلف مدل پولی
۱۰۳	۳-۷ مدل‌های جانشینی بزل رایج
۱۰۵	۳-۸ تحولات اخیر و اظهارات پایانی
۱۱۰	ضمیمه
۱۲۳	فصل چهارم - تجزیه و تحلیل‌های آماری نرخ‌های ارز و آزمون‌های کارایی
۱۲۳	۴-۱ مقدمه

۱۲۳	۴-۲ تجزیه و تحلیل نرخ‌های ارز با استفاده از سری‌های زمانی
۱۳۸	۴-۳ آزمون‌های آماری کارایی به شکل ضعیف
۱۴۸	۴-۴ آزمون کارایی ضعیف نرخ‌های ارز
۱۵۵	۴-۵ آزمون‌های فرم قوی کارایی در نرخ‌های ارز
۱۶۴	۴-۶ توزیع تغییرات در نرخ ارز
۱۶۷	۴-۷ نوسانات نامنظم و مدل‌های واریانس شرطی برای تغییرات حاصله در لگاریتم نرخ ارز
۱۷۹	ضمیمه

فصل پنجم - برابری نرخ بهره، هزینه‌های معاملاتی و نظریه جدید

۱۸۲	۵-۱ مقدمه
۱۸۲	۵-۲ نظریه برابری نرخ بهره با (IRPT)
۱۸۴	۵-۳ هزینه‌های معاملاتی و اصلاحاتی در IRPT
۱۹۱	۵-۴ نظریه مدرن ارزهای سلف
۱۹۴	۵-۵ آزمون IRPT با استفاده از اقتصادسنجی

فصل ششم - نرخ سلف به عنوان پیش‌بینی کننده نرخ نقد ارز در آینده

۱۹۸	۶-۱ مقدمه
۱۹۸	۶-۲ برابری بهره و رابطه بین نرخ‌های ارز نقد و سلف
۲۰۳	۶-۳ دلایل احتمالی شکست فرضیه UEE ("انتظارات کارآ و بدون تورش")
۲۰۵	۶-۴ آزمون‌های اقتصادسنجی از فرضیه انتظارات بدون تورش مو کارآ

فصل هفتم - نقش اخبار و ساختار عبارت جایزه سلف

۲۳۳	۷-۱ مقدمه
۲۳۳	۷-۲ نقش اخبار در تحرکات نرخ نقد ارز
۲۳۴	۷-۳ رویکردهای اقتصادسنجی نسبت به تخمین معادلات اخبار
۲۴۱	۷-۴ مدل اخبار اضافه شده (افزودنی) ادواردز
۲۴۶	۷-۵ شواهد تجربی در مورد اخبار
۲۴۹	۷-۶ جزء ساختاری جایزه سلف
۲۵۴	۷-۷ مدل‌سازی جایزه ریسک صرف زمان (زمان‌بری)

فصل هشتم - تخمین و آزمون مدل‌های نرخ ارز

۲۷۱	۸-۱ مقدمه
۲۷۲	۸-۲ برابری قدرت خرید
۲۷۶	۸-۳ تخمین مدل پولی
۲۸۳	۸-۴ تخمین مدل پولی تحت انتظارات عقلایی