

بررسی تاثیر ناطمینانی نرخ ارز واقعی بر صادرات غیر نفتی در ایران

امید تکبیری^۱ و مرتضی کرد مدانلو^۲

۱ کارشناس ارشد صنایع مدیریت سیستم و بهره وری ، مدرس دانشگاه (نویسنده مسئول)

۲ عضو هیئت علمی دانشگاه

چکیده

بدون تردید می توان گفت یکی از مهم ترین مسائل اقتصادی که ذهن مردم هر کشوری را به خود مشغول می دارد بحث تجارت جهانی است. به طور کلی عوامل موثر بر روی صادرات و واردات در هر کشوری از اهمیت بالایی برخوردار است. برای رسیدن به رشد اقتصادی مناسب می بایست عوامل موثر بر این متغیر مهم اقتصادی به درستی برآورد شوند. در این مقاله به بررسی یکی از عوامل موثر بر صادرات غیر نفتی که تاثیر ناطمینانی حاصل از نرخ ارز واقعی است پرداخته شده و از مدل های ARCH , GARCH بهره گرفته شده است. داده های تحقیق به صورت سالانه و در بازه زمانی سالهای ۱۳۷۰ الی ۱۳۹۱ جمع آوری شده اند.

واژه های کلیدی: ناطمینانی - نوسانات نرخ ارز واقعی - صادرات - ARCH, GARCH