

Euro Dolar Paritesi Nominal Döviz Kurlarını Hangi Yönde Hareket Ettirir? Türkiye Örneği

Özet

Bu çalışma, Euro Dolar paritesindeki değişimin Türkiye'deki nominal Euro/TL ve Dolar/TL kurlarını hangi yönde ve şiddette hareket ettirdiğini, Vektör Otoregresif Model yardımıyla 2000–2012 yılları arasındaki günlük kur değerleri üzerinden incelemektedir. Çalışmanın sonucuna göre bir dönem önceki parite değişimi pozitif olduğunda, Euro/TL kuru yukarı yönlü, Dolar/TL kuru ise aşağı yönlü hareket etmektedir. Parite değişimi negatif olduğunda ise tersi hareket meydana gelmektedir.

Bülent DOĞRU¹
Mustafa UYSAL²

Anahtar Kelimeler: Parite, Döviz Kuru, Vektör Otoregresif Model (VAR)

How Does Euro Dollar Parity Move the Nominal Exchange Rates ? Case of Turkey

Abstract

This paper examines the effect of parity change of Euro Dollar on moving direction of nominal exchange rates in Turkey in context of VAR model over the daily observations within the period of 2000-2012. We figure out that if parity change of Euro Ddollar is positive, the direction of nominal exchange rate of Euro/TL and Dolar/TL is positive and negative respectively. while, the direction of the parity change is negative the signs of Euro/TL and Dollar/TL are opposite of the first condition

Keywords: Parity, Exchange Rates, VAR (Vector Auto Regression)

¹ Yrd. Doç. Dr., Gümüşhane Üniversitesi, İktisat Bölümü, buldogru@gmail.com

² Karadeniz Teknik Üniversitesi Sosyal Bilimler Enstitüsü, uysal61@hotmail.com