

عنوان مقاله:

اثر بی ثباتی تورمی بر رابطه نرخ ارز با تراز تجاری ایران: رویکرد غیرخطی

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 10، شماره 37 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

هاانا ابوالحسن بیگی - دانشجوی دکتری اقتصاد بین الملل دانشگاه تبریز، تبریز، ایران

علیرضا کازرونی - استاد گروه اقتصاد دانشگاه تبریز، تبریز، ایران

محمد مهدی برقی اسگویی - دانشیار گروه اقتصاد دانشگاه تبریز، تبریز، ایران

حسین اصغریور - استاد گروه اقتصاد دانشگاه تبریز، تبریز، ایران

خلاصه مقاله:

یکی از ویژگی های بارز اقتصاد ایران طی چهار دهه اخیر، تورم بالا و بی ثباتی تورمی است. بی ثباتی تورمی با ایجاد بی ثباتی در فضای اقتصادی می تواند روابط بین متغیرهای اقتصادی را تغییر دهد. هدف این مطالعه بررسی اثر غیرخطی بی ثباتی تورمی بر رابطه نرخ ارز با تراز تجاری (غیرنفتی) طی دوره 1352-1395 برای اقتصاد ایران است. برای این منظور ابتدا بی ثباتی تورمی با استفاده از روش گارچ نمایی (EGARCH) کمی سازی شده، سپس مدل تحقیق با استفاده از رهیافت مارکوف سوئیچینگ برآورد شده است. نتایج حاکی از آن است که رفتار تراز تجاری در ایران، قابل تفکیک به سه رژیم (کسری تراز تجاری پایین، متوسط و بالا) است. افزایش نرخ ارز موجب بهبود تراز تجاری در هر سه رژیم شده است. اثر بی ثباتی تورمی بر رابطه نرخ ارز با تراز تجاری در رژیم کسری تراز تجاری بالا و متوسط بسیار ناچیز است و معنادار نیست. در صورتی که در رژیم کسری تراز تجاری پایین منفی و معنادار است. در این رژیم، بی ثباتی تورمی موجب تضعیف اثر نرخ ارز بر تراز تجاری شده است و با افزایش بی ثباتی تورمی رابطه نرخ ارز با تراز تجاری بیشتر تضعیف می شود.

کلمات کلیدی:

نرخ ارز، تراز تجاری، بی ثباتی تورمی، مدل مارکوف سوئیچینگ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1023888>

