

عنوان مقاله:

اثر چرخه های مالی بر چرخه های تجاری در ایران بر اساس رهیافت میانگین گیری بیزین

محل انتشار:

مطالعات و سیاست های اقتصادی، دوره 7، شماره 2 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

نویسندگان:

فرخنده سلیمانی - دانشجوی دکترا اقتصاد دانشگاه سیستان و بلوچستان

محمدنبی شهیکی تاش - دانشیار گروه اقتصاد، دانشگاه سیستان و بلوچستان

غلامرضا زمانیان - دانشیار گروه اقتصاد، دانشگاه سیستان و بلوچستان

رضا زمانی - استادیار گروه اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی

خلاصه مقاله:

هدف محوری این مقاله بررسی ارتباط و اثرات چرخه های مالی بر چرخه های تجاری با تعریف نااطمینانی در مدل مورد نظر است. یکی از تکنیک های متناسب با شرایط عدم اطمینان در مدل، تکنیک میانگین گیری بیزی است. مطالعه حاضر به شناسایی عوامل نیرومند و شکننده موثر چرخه های مالی بر چرخه های تجاری در ایران طی دوره فصلی ۱۳۸۸:۱ تا ۱۳۹۷:۱ مبتنی بر میانگین گیری بیزی پرداخته است. متغیرهای مورد مطالعه تولید ناخالص داخلی، شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران، متوسط هزینه یک مترمربع زیربنا، تسهیلات اعطایی جاری دولتی و غیردولتی، درآمدهای نفتی و پرداخت های جاری دولت می باشند. در این راستا ابتدا با فیلتر هودریک-پرسکات به استخراج چرخه ها پرداخته شده است. سپس برآورد ۸ رگرسیون و میانگین گیری بیزی از ضرایب، نشان می دهد هر ۵ متغیر توضیحی به عنوان مهم ترین عوامل موثر بر چرخه های تجاری در ایران شناسایی شده اند. همچنین مشخص شد که متغیرهای چرخه های شاخص بورس اوراق بهادار، تسهیلات و پرداخت های جاری دولت بر چرخه های تجاری اثر مثبت و متغیرهای چرخه های مسکن و درآمدهای نفتی بر شاخص چرخه های تجاری اثر منفی دارند. نتایج این تحقیق می تواند از منظر سیاست گذاری مورد استفاده برنامه ریزان حوزه اقتصاد کلان قرار گیرد.

کلمات کلیدی:

چرخه های تجاری، چرخه های مالی، مدل بیزینی (BMA)، بازارهای مالی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1246872>

