

عنوان مقاله:

تشخیص اثرات نامتقارن شوک‌های نفت خام بر روی اقتصاد ایران در رژیم های اقتصادی: مدل راه گزینی مارکوف

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 46، شماره 4 (سال: 1390)

تعداد صفحات اصل مقاله: 31

نویسندگان:

علی قنبری - استادیار دانشگاه تربیت مدرس

محسن خضری - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه تربیت مدرس

احمد رسولی - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه تربیت مدرس

خلاصه مقاله:

با توجه به اهمیت بررسی دقیق نوسانات بازار نفت خام بر روی اقتصاد ایران، در این تحقیق اثرات نامتقارن شوک‌های بازار نفت خام بر روی اقتصادی ایران بررسی شده است؛ به طوری که با استفاده از یک مدل چند متغیره‌ی تعمیم یافته‌ی راه گزینی مارکوف با عنوان مدل تصحیح خطای برداری راه گزینی مارکوف (MS-VECM)) و به کارگیری داده های فصلی سال‌های ۱۳۶۸ تا ۱۳۸۶ متغیرهای ارزش افزوده‌ی واقعی بخش صنعت، نرخ ارز موثر واقعی، نرخ تورم، مخارج مصرف دولتی واقعی، واردات واقعی و قیمت نفت واقعی، به مدل سازی و بررسی اثرات نامتقارن شوک‌های بازار نفت خام در رژیم های رکود و رونق بخش صنعت ایران پرداخته شده است. نتایج مقاله نشان دهنده‌ی رفتار نامتقارن متغیرهای مدل به نوسانات قیمت نفت واقعی در رژیم های متفاوت بخش صنعت ایران می باشد؛ به طوری که با حرکت از فاز رکود به فاز رونق شدید بخش صنعت، مکانیزم های اثرگذاری منفی افزایش قیمت نفت بر روی اقتصاد ایران افزایش می یابد. طبقه بندی JEL: E۳۱، E۳۲، G۱۴، Q۴۱، Q۴۳

کلمات کلیدی:

انتقال رژیم، بخش صنعت، شوک‌های نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1309436>

