

عنوان مقاله:

آثار غیرخطی متغیرهای کلان اقتصادی بر رشد اقتصادی با تاکید بر نرخ ارز (مورد ایران)

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 45، شماره 4 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 29

نویسندگان:

محسن مهرآرا - دانشیار دانشکده ی اقتصاد دانشگاه تهران

اکبر سرخوش - کارشناس ارشد اقتصاد

خلاصه مقاله:

در این مقاله ضمن آزمون عدم تقارن نوسانات نرخ ارز (بر حسب تکانه های مثبت و منفی) بر تولید حقیقی، با استفاده از الگوی رگرسیونی سری زمانی غیرخطی (STR)، به تبیین عوامل تعیین کننده ی رشد تولید حقیقی در اقتصاد ایران طی دوره ی ۱۳۳۸-۱۳۸۶ می پردازیم. در تصریح معادله ی رشد تولید، علاوه بر لحاظ کردن تکانه های مثبت و منفی نرخ ارز، تاثیر سایر عوامل (متغیرهای کنترلی) شامل هر دو گروه عوامل طرف عرضه (مانند درآمدهای نفتی و سرمایه گذاری) و عوامل طرف تقاضا (مانند مخارج دولت) مورد توجه قرار گرفته است. نتایج به دست آمده زمینه ی فرضیه ی اصلی تحقیق مبنی بر عدم تقارن تکانه های مثبت و منفی نرخ ارز دلالت بر آن دارد که تکانه های منفی اثرات به مراتب بیش تری بر کاهش رشد اقتصادی نسبت به تکانه های مثبت دارد. در حقیقت؛ تکانه های منفی نرخ ارز حقیقی (تقویت ارزش حقیقی پول داخلی) رشد اقتصادی را کاهش می دهد، در حالی که تکانه های مثبت نرخ ارز اثر مشابهی بر تولید نداشته و قادر نیست تولید را به سطح اولیه ی آن برگرداند. در ادامه با استفاده از مدل های غیرخطی STR و بررسی روابط میان تولید و متغیرهای سیاستی، ضمن مشاهده ی افزایش قدرت توضیح دهندگی مدل، می توان نتیجه گرفت که رشد تولید حقیقی در اقتصاد ایران نسبت به سطوح متفاوت رشد مخارج دولتی رفتاری نا متقارن نشان می-دهد. متغیرهای کاهش نرخ ارز، نسبت سرمایه گذاری به تولید، مخارج دولت و عدم تعادل پولی در رژیم پایین مخارج دولتی، اثرات بااهمیتی بر رشد اقتصادی دارند، اما در رژیم بالا اثرات متغیرهای مذکور به میزان قابل توجهی کاهش پیدا می کند. طبقه بندی JEL: O۲۳, F۳۱, C۱۳, C۰۱

کلمات کلیدی:

اثرات نامتقارن، تولید ناخالص داخلی، مخارج دولتی، مدل STR، نرخ ارزش حقیقی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1309828>

