

عنوان مقاله:

یک الگوی ساختاری VAR برای اقتصاد ایران

محل انتشار:

فصلنامه پژوهشنامه اقتصادی، دوره 10، شماره 36 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 27

نویسندگان:

ناصر خیابانی - استادیار موسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه ریزی

جمشید پژویان - استاد دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبائی

اکبر کمیجانی - استاد دانشکده اقتصاد - دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

مقاله حاضر بر اساس یک الگوی VAR ساختاری، آزمون بردار هم انباشتگی در فرآیند (۱/۲)، تبدیل سیستم (۱/۲) به (۱/۱) و وجود متغیرهای برونزای ضعیف در سیستم، به توضیح رفتار بازار پول، بازار ارز، تورم، نقش سرکوب مالی در بازار سرمایه و تعامل بین بازار داراییها می پردازد. این نوشتار به توضیح رفتار بازار پول، بازار ارز، تورم، نقش سرکوب مالی در بازار سرمایه در رشد اقتصادی و تعامل بین داراییها می پردازد. یافته های تجربی دلالت بر این دارند که در دوره ۸۵-۱۳۷۱ همگنی بلندمدت بین قیمت و پول برقرار نبوده و رابطه باثبات تقاضا پول بطور تجربی تایید نمی شود. رابطه همگنی بلندمدت بین دو بازار دارایی (بازار ارز و بازار کالاهای غیرقابل تجارت) برقرار بوده، اما جهت حرکتی آنها خلاف یکدیگر است. علیرغم اینکه تئوری اقتصاد بر کوتاه مدت بودن اثر شوکهای پولی روی متغیرهای واقعی تاکید دارد. یافته های ما نشان می دهد که در دوره فوق، تراز واقعی پول بخشی از رشد تولید را توضیح می دهد.

کلمات کلیدی:

ایران، آزمون همجمعی، الگوی VAR، مدل آماری (۱/۱) و (۱/۲)، تورم، بازار ارز، نقدینگی، ارزش واقعی ریال

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1409898>

