

## عنوان مقاله:

عوامل موثر بر انتقال نوسانات قیمت نفت خام به رشد بخش صنعت و معدن در ایران: رهیافتی از مدل های تبدیل مارکف

## محل انتشار:

فصلنامه انرژی ایران، دوره 16، شماره 3 (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

## نویسندگان:

حسن حیدری

سحرناز بابایی بالدرلو

## خلاصه مقاله:

مقاله حاضر عوامل انتقال دهنده نوسانات قیمت نفت خام را به رشد بخش صنعت و معدن، طی دوره زمانی ۱۳۶۷:۱-۱۳۸۹:۴ مورد بررسی قرار می دهد. بدین منظور، بعد از به دست آوردن سری زمانی مربوط به همبستگی پویای قیمت نفت خام و رشد بخش صنعت و معدن با استفاده از مدل DCC، متغیرهای کلان اقتصادی توضیح دهنده همبستگی پویای بین این دو متغیر بر اساس مدل MSIXH(۲) (ARX(۰,۰) مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج حاکی از آن است که برآیند اثرگذاری قیمت نفت خام از طریق متغیرهای مورد مطالعه بر رشد بخش صنعت و معدن مثبت است و با کنترل متغیرهای واردات واقعی، مخارج مصرفی واقعی دولت، تورم، نرخ ارز موثر واقعی و قیمت نفت، می توان از تغییرات قیمت نفت در جهت رشد هرچه بیشتر بخش صنعت بهره برد. لذا پیشنهاد می شود با افزایش واردات کالاهای واسطه ای به همراه سیاست های ساختاری در جهت افزایش قدرت رقابتی محصولات داخلی و اجرای سیاست های توسعه صادرات غیر نفتی، کاهش مخارج مصرفی دولت و همچنین اجرای سیاست هایی در جهت تثبیت سطح عمومی قیمت ها و مخارج مصرفی دولت در مقابل تغییرات قیمت نفت، در جهت افزایش رشد بیشتر بخش صنعت و معدن اقدام شود.

## کلمات کلیدی:

,Crude Oil Price, Industry and Mine Sector Growth, DCC, Markov-Switching Models, Contagion

قیمت نفت خام، رشد بخش صنعت و معدن، DCC، مدل های تبدیل مارکف، انتقال نوسانات

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1436925>

