

عنوان مقاله:

اثر شوک نرخ ارز بر تورم کشورهای منتخب در حال توسعه با رویکرد خودرگرسیون برداری ساختاری پانلی برای دوره ۱۹۹۰-۲۰۲۰

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد کاربردی، دوره 12، شماره 41 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

نویسندگان:

مرجان محمداسماعیل - دانشجوی دکتری، گروه اقتصاد، واحد الیگودرز، دانشگاه آزاد اسلامی، الیگودرز، ایران

رضا معبودی - استادیار، گروه اقتصاد، دانشکده علوم انسانی، دانشگاه آیت الله العظمی بروجردی، بروجرد، ایران (نویسنده مسئول).

محمد خرسند - استادیار، گروه اقتصاد، واحد الیگودرز، دانشگاه آزاد اسلامی، الیگودرز، ایران

خلاصه مقاله:

مقاله حاضر به بررسی اثر شوک نرخ ارز بر تورم در کشورهای در حال توسعه نفتی و غیرنفتی با استفاده از مدل خودرگرسیون برداری ساختاری پانل (Panel-SVAR) و خودرگرسیون برداری با پارامترهای زمان (Panel-TVPVAR) برای سال های ۱۹۹۰ تا ۲۰۲۰ می پردازد. در این پژوهش با استفاده از آزمون ریشه واحد داده های پانلی، هم انباشتگی و وابستگی مقطعی الگوها برآورد می شود. نتایج حاکی از آن است که در دوره مورد بررسی، یکی از عوامل کلیدی و اثرگذار برتورم تغییرات نرخ ارز بوده است که سبب ایجاد تورم ساختاری در کشورهای مورد مطالعه گردیده و با افزایش شوک ها در درآمدهای ارزی، رشد ذخایر ارزی بانک مرکزی کشورهای در حال توسعه نیز کاهش می یابد. نتایج حاکی از آن است که در دوره مورد بررسی، یکی از عوامل کلیدی و اثرگذار برتورم تغییرات نرخ ارز بوده است که سبب ایجاد تورم ساختاری در کشورهای مورد مطالعه گردیده و با افزایش شوک ها در درآمدهای ارزی، رشد ذخایر ارزی بانک مرکزی کشورهای در حال توسعه نیز کاهش می یابد.

کلمات کلیدی:

شوک نرخ ارز، تورم، خودرگرسیون برداری ساختاری پانل، خودرگرسیون برداری ساختاری با پارامترهای متغیر در زمان

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1555802>

