

عنوان مقاله:

تحلیل رفتار فشار بازار ارز در اقتصاد ایران: رویکرد مدل خودرگرسیون برداری آستانه ای (TVAR)

محل انتشار:

مجله سیاست گذاری اقتصادی، دوره 11، شماره 21 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

نویسندگان:

الهام امراللهی - Department of Economic, Management and Accounting, Yazd Branch, Islamic Azad University, Yazd, Iran

سید یحیی ابطی - Department of Economic, Management and Accounting, Yazd Branch, Islamic Azad University, Yazd, Iran

طاہرہ علی حیدری بیوکی - Department of Industrial Engineering, Faculty of Engineering, Islamic Azad University, West Tehran Branch, Tehran, Iran

خلاصه مقاله:

قدرت تاثیر تغییرات نرخ ارز بر قیمت های داخلی نقش کلیدی در طراحی و اجرای سیاست های اقتصاد کلان ایفا می کند. بنابراین درک فشار بازار ارز در جهت مدیریت موثر اقتصاد کلان، به ویژه برای اقتصادهای در حال توسعه بسیار مهم است. این مطالعه درصدد است تا به بررسی و تحلیل رفتار شاخص فشار بازار ارز در اقتصاد ایران طی دوره ی زمانی ۴:۱۳۹۶-۴:۱۳۶۷ بپردازد. بدین منظور، با بکارگیری روش ادواردز (۲۰۰۲) و کوماه (۲۰۰۷)، شاخص فشار بازار ارز محاسبه گردیده است. با توجه به ماهیت غیر خطی رفتار شاخص فشار بازار ارز در ایران، نتایج بکارگیری مدل خودرگرسیون برداری آستانه ای (TVAR) در این خصوص نشان می دهد که در رژیم پایین فشار بازار ارز، مقادیر با وقفه ی متغیرها اثر معنا داری بر فشار بازار ارز ندارند اما با چرخش رژیم و قرار گرفتن در رژیم بالای فشار بازار ارز، با افزایش تقدینگی و تورم، شاخص فشار بازار ارز افزایش می یابد. در نتیجه، اعمال سیاست های پولی انقباضی و سیاست کنترل تورم در دوران افزایش فشار بازار ارز، می تواند این فشار را تعدیل نماید.

کلمات کلیدی:

Exchange market pressure, Monetary policy, Threshold Vector Autoregressive Model

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1935575>

