

عنوان مقاله:

بررسی اثرات نامتقارن نااطمینانی بر عملکرد اقتصاد کلان در ایران: مشاهداتی بر پایه مدل VARMA, MVGARCH-M

محل انتشار:

مجله سیاست گذاری اقتصادی، دوره 7، شماره 14 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

سید کمال صادقی - دانشیار دانشکده اقتصاد، مدیریت و بازرگانی، دانشگاه تبریز

حامد عبدالملکی - دانشجوی دوره دکتری، اقتصاددانشگاه تبریز

الهام وفائی - دانشجوی دوره دکتری، اقتصاددانشگاه تبریز

خلاصه مقاله:

اثرات نااطمینانی اقتصاد کلان اعم از اسمی (تورم) و حقیقی (رشد تولید) بر عملکرد و کارایی اقتصاد از جمله موضوعات مهم و پیچیده می باشد. هزینه های تورم بالا و نااطمینانی تورم اثرات نامطلوب و جبران ناپذیری را بر پیکره اقتصاد و رفاه جامعه وارد می سازد. جدای از روند تورم در طول زمان، نااطمینانی تورم نیز ممکن است رشد تولید را تحت تاثیر قرار دهد. همانند نااطمینانی تورم، نااطمینانی رشد تولید نیز می تواند اثرات مثبت و یا منفی بر رشد و تورم داشته باشد. این تحقیق به بررسی اثر رابطه بین تورم، نااطمینانی تورم، تولید و نااطمینانی تولید در ایران با استفاده از داده های فصلی ۱۳۹۰:۱-۱۳۶۹:۴ می پردازد. مدل مورد استفاده در این پژوهش، مدل نامتقارن VARMA, MVGARCH-M و روش برآورد شبه حداکثر راستنمایی (QML) می باشد. نتایج حاکی از آن است که نااطمینانی رشد تولید اثر منفی و معناداری بر رشد تولید و اثر مثبت و معناداری بر تورم داشته است. از سوی دیگر نااطمینانی تورم اثر مثبت و معناداری بر تورم طی دوره مورد بررسی داشته است اما اثر آن بر رشد تولید معنادار نبوده است. همچنین، نتایج نشان می دهد که ماتریس واریانس-کواریانس شرطی تورم و رشد تولید، نامتقارن و غیر قطری می باشد.

کلمات کلیدی:

Inflation uncertainty, Output growth uncertainty, Asymmetry, Iran, VARMA, MVGARCH-M Model

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1935675>

