

## عنوان مقاله:

برآورد گذر نرخ ارز در ایران: بررسی اثر تغییرات نرخ ارز بر شاخص قیمت مصرف کننده

## محل انتشار:

فصلنامه پژوهشها و سیاست های اقتصادی، دوره 28، شماره 96 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 32

## نویسندگان:

سید مهدی برکچیان - موسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه ریزی

احمد برکیش - موسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه ریزی

ابوالحسن والی زاده - موسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه ریزی

## خلاصه مقاله:

هدف از این مطالعه، به دست آوردن یک تصویر نسبتاً دقیق از رابطه میان نرخ ارز و شاخص قیمت مصرف کننده در ایران طی سه دهه گذشته است. نتایج به دست آمده از آزمون علیت گرنجری در فضای بسامدی، شواهد قوی از علیت از نرخ ارز به شاخص قیمت مصرف کننده به ویژه در افق های زمانی بلندمدت (بیش از ۵ فصل) ارائه می دهد. تحلیل موجک نشان می دهد که در هنگام بروز بحران های ارزی (همانند آنچه در اوایل دهه ۷۰ و اوایل دهه ۹۰ اتفاق افتاد) متغیر نرخ ارز عاملی بسیار مهم در توضیح پویایی های شاخص قیمت مصرف کننده، هم در افق کوتاهمدت (بسامدهای بالا) و هم در افق بلندمدت (بسامدهای پایین)، بوده است. نتایج حاصل از مدل حالت-فضا نیز نشان می دهد که سیاست تثبیت نرخ اسمی ارز در دوره وفور درآمد ارزی، هرچند به صورت مقطعی باعث کاهش گذر نرخ ارز شده اما همواره متعاقب آن و در هنگام تکانه ارزی، جهش در گذر نرخ ارز ظاهر شده است.

## کلمات کلیدی:

State-space model, Breitung-Candelon test, Wavelet analysis, Exchange rate pass-through to CPI

مدل حالت-فضا، فیلتر کالمن، آزمون برایتانگ-کاندلون، تحلیل موجک، گذر نرخ ارز به شاخص قیمت مصرف کننده

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/2022464>

