

عنوان مقاله:

بررسی رابطه بین نرخ ارز واقعی و قیمت نفت و وقوع بیماری هلندی در ایران بر اساس رهیافت M-TAR

محل انتشار:

اولین همایش الکترونیکی ملی چشم انداز اقتصاد ایران «با رویکرد حمایت از تولید ملی» (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

سعید دائی کریم زاده - استادیار، دانشگاه آزاد اسلامی واحد خوراسگان (اصفهان)

مجید سامتی - دانشیار، دانشگاه اصفهان

شاهین زیدیحیایی - دانش آموخته کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد خوراسگان

خلاصه مقاله:

این مقاله به بررسی رابطه بین نرخ واقعی ارز و قیمت نفت در کشور ایران از سال 1962 تا 2011 و به منظور تشخیص بیماری هلندی در آن می پردازد. بیماری هلندی به وضعیتی اطلاق می شود که در آن به دنبال کشف یک منبع طبیعی همچون نفتو در نتیجه افزایش عواید ارزی حاصل از آن، نرخ ارز واقعی کاهش و قدرت رقابت پذیری کشور تضعیف می شود. در روش های سنتی برای توصیف رابطه بین نرخ ارز و قیمت نفت از آزمون هم انباشتگی استفاده می شد. فرض اساسی در این روش تعدیل متقارن نرخ ارز در واکنش نسبت به انحراف های مثبت و منفی قیمت نفت از تعادل است، اما از آنجا که عوامل متعددیاز جمله دخالت های دولتی موجب واکنش های نامتقارن در نرخ واقعی ارز نسبت به قیمت نفت می شود، نتایج به دست آمده از این روش نامعتبر می شود. روش آستانه تکانه خودتوضیحی (M-TAR) ، یک روش منحصر به فرد در استفاده از الگو های غیر خطی و یا الگو های با فرض عدم تقارن اطلاعات می باشد. در این مطالعه با استفاده از روش آستانه تکانه خودتوضیحی (M-TAR) (به بررسی رابطه کوتاه مدت و بلند مدت بین قیمت نفت و نرخ ارز واقعی در ایران پرداخته شد که نتایج حاکی از آن است که: الف) رابطه علیت بلند مدتی از قیمت نفت به نرخ واقعی ارز وجود دارد (ب) رابطه علیت کوتاه مدت از نرخ واقعی ارز به قیمت واقعی نفت و برعکس وجود ندارد (ج) نرخ واقعی ارز نسبت به انحرافات منفی قیمت نفت از تعادل واکنش سریعتری نشان می دهد. بنابراین نتایج حاصل از برآورد الگو از وجود بیماری هلندی در ایران حکایت دارد

کلمات کلیدی:

نرخ واقعی ارز ، قیمت نفت ، الگوی تکانه آستانه خود توضیحی (M-TAR) ، بیماری هلندی ، عدم تقارن

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/260235>

