

عنوان مقاله:

بررسی وجود اثرات نامتقارن نوسانات مثبت و منفی نرخ ارز بر سرمایه گذاری بخش خصوصی

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 5، شماره 20 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

علیرضا عرفانی - دانشیار اقتصاد و عضو هیئت علمی دانشگاه سمنان

عابدین حسینی - دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه سمنان نویسنده مسئول

حمید ملکی - کارشناس ارشد اقتصاد دانشگاه علامه طباطبایی

خلاصه مقاله:

هدف اصلی در این مقاله بررسی و آزمون اثرات نامتقارن نوسانات نرخ ارز بر حسب تکانه های مثبت و منفی بر سرمایه گذاری بخش خصوصی در ایران است. برای بررسی شوکهای ارز در ابتدا با استفاده از فیلتر هودریک - پرسکات شوکهای پیش بینی شده و شوکهای پیش بینی نشده مثبت و منفی استخراج شده است. در ادامه در تصریح معادله سرمایه گذاری بخش خصوصی علاوه بر لحاظ این شوک ها تاثیر متغیرهای دیگر نظیر تولید ناخالص داخلی بدون نفت و سرمایه گذاری دولتی مورد توجه قرار گرفته است. برای این منظور با استفاده از الگوی خودبازگشتی با وقفه های توزیعی ARDL و همچنین الگوی تصحیح خطا ECM وجود رابطه بلندمدت و کوتاه مدت میان سرمایه گذاری بخش خصوصی و عوامل موثر بر آن طی سالهای 1389-57 مورد ارزیابی قرار گرفته است. نتایج حاصل حاکی از اثرات نامتقارن نرخ ارز بر سرمایه گذاری بخش خصوصی است. به طوریکه شوکهای مثبت نرخ ارز اثرات بیشتری نسبت به شوکهای منفی دارند.

کلمات کلیدی:

نوسانات نرخ ارز/عدم تقارن /سرمایه گذاری بخش خصوصی /مدل ARDL

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/405453>

