

عنوان مقاله:

انحراف نرخ ارز از مسیر تعادلی و تاثیر آن بر چرخه های تجاری در ایران

محل انتشار:

فصلنامه نظریه های اقتصاد مالی، دوره 2، شماره 2 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

نسیبه زارعی - کارشناسی ارشد اقتصاد کشاورزی دانشگاه شهید باهنر کرمان

مهدی خسروی - دانشجوی دکتری اقتصاد کشاورزی دانشگاه شهید باهنر کرمان

سیدعبدالمجید جلائی - دانشیار دکتری اقتصاد عضو هیات علمی دانشگاه شهید باهنر کرمان

خلاصه مقاله:

با توجه به آنکه نرخ ارز و انحراف آن از مسیر تعادلی یکی از مهمترین عوامل موثر بر متغیرهای کلان اقتصادی هر کشور بوده و چگونگی نوسان چرخه های تجاری نیز می تواند بر روند اجرای سیاست اقتصادی تاثیر داشته باشد. در این مقاله سعی شده پس از نشان دادن وجود انحراف نرخ ارز مسیر تعادلی تاثیر آن بر چرخه های تجاری در اقتصاد ایران بررسی شود. برای رسیدن به این هدف از داده های سری زمانی 90-1352 استفاده و به کمک مدل خود توضیح با وقفه های گسترده ARDL روابط کوتاه مدت و بلندمدت بین انحراف نرخ ارز و چرخه های تجاری سنجیده شده است. برای شاخص چرخه های تجاری نیز از فیلتر هودریک پرسکات HP به استفاده شده. پس از تایید رابطه بلندمدت نتایج حاکی از آن است که انحراف نرخ ارز بر چرخه های تجاری در اقتصاد ایران در بلندمدت تاثیرگذار است به طوری که افزایش انحراف نرخ ارز باعث ایجاد نوسانات بیشتر در چرخه های تجاری می شود ضریب جمله تصحیح خطا ECM به دست آمده در این مدل، نشان می دهد که در هر دوره 41 درصد از عدم تعادل در چرخه های تجاری تعدیل شده و به سمت روند بلندمدت خود نزدیک شده است.

کلمات کلیدی:

انحراف نرخ ارز، چرخه های تجاری، خود توضیح با وقفه های گسترده

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/646278>

