

عنوان مقاله:

تاثیر نرخ ارز بر شاخصهای کلان اقتصادی در ایران (با رویکرد راهگزینی مارکف VAR-MS)

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی پژوهش های نوین در مدیریت، اقتصاد و علوم انسانی (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

نویسندگان:

سیدیحیی ابطی - استاد یار، گروه اقتصاد، پردیس علوم و تحقیقات یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران - گروه اقتصاد، واحد یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران

حسین صابری زاده - دانش آموخته کارشناسی ارشد، گروه اقتصاد، پردیس علوم و تحقیقات یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران - گروه اقتصاد، واحد یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران

خلاصه مقاله:

در مقاله حاضر به بررسی تاثیر نرخ ارز بر شاخصهای کلان اقتصادی در ایران پرداخته شد. با توجه به نتایج رویکرد راهگزینی مارکف VAR-MS نحوه اثرگذاری متغیر نرخ ارز بر متغیرهای کلان (رشد اقتصادی، تورم و نقدینگی) غیرخطی ارزیابی گردید. نتایج تحقیق حاکی از تبعیت مدل های مربوطه در دو رژیم اقتصادی بالا و پایین است. با توجه به نتایج تحقیق در حالت رژیم یک که مصادف با رشد اقتصادی پایین، نقدینگی پایین و تورم پایین است بیشترین تاثیر را متغیر نرخ ارز بر متغیر رشد اقتصادی با 99/0 واحد متغیر نقدینگی با 5/0 واحد و تورم با 42/0 واحد داشته است. در نتیجه میتوان بیان داشت نرخ ارز در رژیم یک بر متغیرهای حقیقی (رشد اقتصادی) نسبت به متغیر قیمتی (تورم و نقدینگی) بیشترین تاثیر را داشته است. همچنین در رژیم دو که مصادف با رشد اقتصادی بالا، نقدینگی بالا و تورم بالا است بیشترین تاثیر را متغیر نرخ ارز بر نقدینگی با 92/0 واحد، تورم با 75/0 واحد و رشد اقتصادی با 064/0 - واحد، داشته است. در نتیجه میتوان بیان داشت نرخ ارز در رژیم دو بر متغیرهای قیمتی (تورم و نقدینگی) نسبت به متغیر مقداری (رشد اقتصادی) تاثیر بیشتری داشته است.

کلمات کلیدی:

نقدینگی، تورم، نرخ ارز، رشد اقتصادی، راهگزینی مارکف

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/649811>

