

عنوان مقاله:

انتقال نامتقارن نرخ ارز به شاخص های قیمت داخلی با رویکرد svar

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 19، شماره 60 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 29

نویسندگان:

جاوید بهرامی - استادیار دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبایی

تیمور محمدی - دانشیار دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبایی

شادی بزرگ - دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه علامه طباطبایی

خلاصه مقاله:

از منظر سیاست گذاری درک اثر نوسانات نرخ ارز بر قیمت ها معیاری مناسب جهت ارزیابی سیاست های پولی محسوب می شود این مطالعه با تحلیل داده های فصلی سال 1369 تا 1392 به کمک مدل خود رگرسیون برداری ساختاری SVAR به ارزیابی این موضوع پرداخته که تا چه حد و چگونه نوسانات نرخ ارز قیمت های داخلی ایران را تحت تاثیر قرار می دهد علاوه بر متغیرهای نماینده عدم تقارن انتقال نرخ ارز و شکاف تولید رشد متغیرهای نقدینگی تورم مصرف کننده تورم تولید کننده و قیمت هایی وارداتی نیز در مدل استفاده شده است یافته های اصلی این مقاله را می توان این طور بیان کرد اول نتایج مویب وجود عدم تقارن انتقال نرخ ارز در اقتصاد ایران هستند و نحوه انتقال به قیمت های داخلی متفاوت است دوم در مجموع در بین چهار متغیر نشانگر عدم تقارن تغییرات کاهشی کوچک نرخ ارز بر قیمت ها بی اثر شناخته شده است در حالیکه تغییرات افزایشی نرخ ارز و بطور ویژه افزایش های بیش از حد آستانه نرخ ارز بیشترین تاثیر گذاری را بر متغیرهای قیمتی دارد سوم ماندگاری انتقال در شاخص قیمت های مصرف کننده بیش از سایر متغیرهاست

کلمات کلیدی:

انتقال نرخ ارز، تورم، روش خودرگرسیونی برداری داخلی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/682299>

