

عنوان مقاله:

اثرات نامتقارن نوسان های نرخ واقعی ارز بر صادرات غیرنفتی ایران رویکرد غیرخطی مارکوف- سویچینگ

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات مدل سازی اقتصادی، دوره 2، شماره 5 (سال: 1390)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

نویسندگان:

علیرضا کازرونی - استاد گروه اقتصاد دانشگاه تبریز

علی رضازاده - دانشجوی دکترا دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات

سیاوش محمدپور - دانشجوی کارشناس ارشد دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات

خلاصه مقاله:

هدف اصلی این مطالعه بررسی اثرات نامتقارن نرخ ارز واقعی بر صادرات غیرنفتی در ایران در دوره ی زمانی 1386-1353 است. بنابراین، در راستای هدف تحقیق، ابتدا شوک های مثبت و منفی نرخ ارز با استفاده از مدل غیرخطی مارکوف- سویچینگ بررسی شده است. برای برآورد مدل غیرخطی نرخ ارز بر اساس مقدار تابع راست نمایی، مدل MSIH با سه رژیم از میان حالت های مختلف مدل MS برگزیده شد. در مرحله ی بعد، مدل اصلی تحقیق با استفاده از روش های همانباشتگی جوهانسن- جوسیلیوس و DOLS برآورد شد. بر اساس نتایج به دست آمده متغیرهای درآمد خارجی، درآمد ناخالص داخلی، رابطه ی مبادله و درجه ی باز بودن تجاری، اثر مثبت و معنی دار بر صادرات غیرنفتی داشته که با مبانی نظری و مطالعات تجربی سازگار است. هر دو شوک های مثبت و منفی نرخ ارز نیز تاثیر منفی و معنی دار بر صادرات غیرنفتی بر جای گذاشته است. بر اساس آزمون والد و LR اثرات شوک های گفته شده نامتقارن بوده، به گونه ای که شوک های مثبت به گونه ای معنی دار بیشتر از شوک های منفی، صادرات غیرنفتی را متاثر می سازد.

کلمات کلیدی:

صادرات غیرنفتی، نرخ ارز واقعی، اثرات نامتقارن، مدل مارکوف- سویچینگ

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/790297>

