

عنوان مقاله:

میزان عبور نرخ ارز به شاخص قیمت واردات به شرط تکانه های وارد بر اقتصاد و تاثیر تغییر در انحراف معیار تکانه ها بر آن: رهیافت الگوی تعادل عمومی پویای تصادفی

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 8، شماره 31 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

متین سادات برقی - دانشجوی دکتری علوم اقتصادی دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

تیمور محمدی - دانشیار دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

تحلیل چگونگی عبور نرخ ارز به قیمت های داخلی یعنی رابطه تغییر نرخ ارز و قیمت ها و عوامل موثر بر آن در وضع سیاست گذاری های بهینه در اقتصادهای باز و همچنین در فهم اثرات انتقال تکانه ها اهمیت زیادی دارد. در این مطالعه برای بررسی چگونگی عبور نرخ ارز به شاخص قیمت های وارداتی در ایران از یک الگوی ساختاری تعادل عمومی پویای تصادفی استفاده شده است. در این الگو تغییرات نرخ ارز درون زا در نظر گرفته شده و نه برون زا. در نتیجه این امکان فراهم آمده که عبور نرخ ارز به شرط هر یک از تکانه های وارد بر اقتصاد جداگانه محاسبه شود. مزیت استفاده از این الگو این است که به سیاست گذار نشان می دهد که عبور نرخ ارز به قیمت ها همیشه به یک میزان نیست و در سیاست گذاری، اینکه کدام تکانه سبب تغییر نرخ ارز و قیمت ها شده را باید لحاظ کرد. از این رو ابتدا، یک الگوی تعادل عمومی پویای تصادفی برای اقتصاد ایران ارائه و سپس مقاردهی و شبیه سازی شده است. سپس با استفاده از توابع ضربه-واکنش، عبور نرخ ارز به شرط هر یک از تکانه های وارد بر اقتصاد (تکانه تکنولوژی، درآمد نفتی، تقاضای خارجی، تقاضای پول، نرخ بهره خارجی و سیاست پولی) جداگانه محاسبه گردید. نتایج حاکی از آن است که انتقال نرخ ارز در ایران ناقص است و درجه انتقال با توجه به هر شوک وارد بر اقتصاد متفاوت است و بعد از بیست فصل به حدود 40 تا 70 درصد می رسد. هدف دیگر مقاله بررسی اثر افزایش واریانس تکانه ها بر عبور نرخ ارز بود. از آنجایی که افزایش انحراف معیار تکانه ها، مقیاس توابع ضربه واکنش را تغییر می دهد ولی شکل آنها را تغییر نمی دهد، اندازه نسبی این واکنش ها نسبت به هم و در نتیجه، عبور نرخ ارز تغییر نمی کند.

کلمات کلیدی:

عبور نرخ ارز به قیمت های وارداتی، اقتصاد باز کوچک، الگوی تعادل عمومی پویای تصادفی، انحراف معیار تکانه ها

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/885828>

