

عنوان مقاله:

انحراف نرخ واقعی ارز و تورم در ایران: شواهدی جدید بر پایه ی رهیافت چرخشی مارکوف

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد کاربردی، دوره 7، شماره 23 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

نویسندگان:

محمدعلی احسانی - دانشیار دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران

صالح طاهری بازخانه - دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه مازندران، بابلسر، دانشگاه مازندران

حمید لعل خضری - دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه مازندران، بابلسر، دانشگاه مازندران (نویسنده مسئول) h.lalkhezri@stu.umz.ac.ir

خلاصه مقاله:

انحراف نرخ حقیقی ارز از مقدار تعادلی آن یکی از مباحث مناقشه آمیز در اقتصاد ایران است. از یک طرف، با به چالش کشیدن نظریه ی برابری قدرت خرید این ایده مطرح است که باید دولت از کاهش ارزش واقعی ریال جلوگیری کرده و مانع انتقال نرخ ارز به تورم شود. از طرف دیگر، آسیب هایی که انحراف نرخ ارز بر تولید داخلی، صادرات غیرنفتی و اشتغال دارد، باعث می شود از آن به عنوان پدیده ای نامطلوب یاد شود. در این راستا، پژوهش حاضر با این ایده که اثرات انحراف نرخ ارز به محیط تورمی بستگی دارد، اثرگذاری غیرخطی انحراف نرخ ارز بر تورم را در بازه ی ۱۳۹۳:۴-۱۳۶۰:۲ بررسی کرده است. نتایج حاصل از برآورد الگوی ارائه شده توسط عطیف علی جفری (۲۰۱۰) به کمک رهیافت چرخشی مارکوف، نشان می دهد زمانی که تورم میانگین بالا و نوسان شدید را تجربه می کند انحراف نرخ ارز اثر منفی بسیار ناچیزی بر تورم دارد. اما مادامی که در فاز میانگین اندک و کم نوسان قرار می گیرد، افزایش در انحراف نرخ ارز فشار تورمی ایجاد خواهد کرد. بنابراین، نه تنها ارزش گذاری بیش از اندازه ی نرخ ارز در مواقعی که تورم افزایش فزاینده دارد اثرات مطلوب و چشم گیر بر تورم ندارد، بلکه تهدیدی جدی برای ثبات و کاهش تورم محسوب می شود. با تحلیل نتایج حاصل از این مطالعه، دلالت های سیاستی مهمی فراهم شده است. طبقه بندی JEL: F۳۱، E۳۱، C۳۴.

کلمات کلیدی:

انحراف نرخ ارز، عبور نرخ ارز، تورم، رهیافت چرخشی مارکوف

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1324571>

