

## عنوان مقاله:

روابط ساختاری بین ذخایر پولی ایران و تورم با استفاده از الگوی VAR

## محل انتشار:

پنجمین کنفرانس بین المللی مدیریت، حسابداری و توسعه اقتصادی (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

## نویسندگان:

مهدی مرادی - استادیار گروه علوم اقتصادی، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران

جعفر یوسفی - دانشجوی دکتری دانشگاه آزاد اسلامی، واحد میانه، گروه اقتصاد، آذربایجان شرقی، ایران

## خلاصه مقاله:

در دهه گذشته با پیشرفت تورم در اقتصاد شاهد توجه هر چه بیشتر به روابط بین ذخایر پولی و تورم در حوزه اقتصاد هستیم. در این پژوهش از شاخص قیمت مصرف کننده (CPI) به عنوان یکی از مهمترین شاخصه ها برای محاسبه ی میزان تورم استفاده می کنیم. و گردش پول  $M_0$ ، محاسبات محدود  $M_1$ ، محاسبات گسترده  $M_2$ ، شاخص قیمت مصرف کننده را به صورت داده های ماهیانه به عنوان نمونه انتخاب می کنیم و بردار خودهمبسته (VAR) را ایجاد می کنیم. همچنین برای عملکرد واکنش های لحظه ای و تجزیه واریانس از الگوهای اقتصادسنجی استفاده خواهیم کرد. در نهایت هم پول در گردش  $M_0$ ، محاسبات محدود  $M_1$ ، محاسبات گسترده  $M_2$  و روابط بین شاخص قیمت مصرف کننده CPI و میزان تاثیرات مختلف بر تورم را در ارتباط با ذخایر پولی مشخص می کنیم. برای مطالعه تجربی این الگو از داده های اقتصاد کشور در دوره زمانی 1387 تا 1397 استفاده کردیم.

## کلمات کلیدی:

بردار خودهمبسته، علیت گرنجر، آزمون ایستایی و تابع واکنش تکانه ای طبقه بندی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1124715>

