

عنوان مقاله:

خنثایی پول و عدم تقارن در شوک های پولی در اقتصاد ایران با در نظر گرفتن اندازه و جهت شوک ها

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق), دوره 9, شماره 4 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 27

نویسندگان:

تیرداد احمدی - استادیار گروه مدیریت مالی دانشکده مدیریت دانشگاه آزاد اسلامی واحد تهران مرکز

احمد عزتی شورگلی - دانشجوی دکتری اقتصاد بین الملل دانشکده اقتصاد و مدیریت دانشگاه ارومیه

پریسا صحرائی - کارشناس ارشد علوم اقتصادی دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

هدف این مطالعه بررسی تاثیر شوک های پولی کوچک و بزرگ (با لحاظ جهت شوک) بر تولید، با استفاده از داده های فصلی طی دوره ی زمانی (۱۳۶۹:۱-۱۳۹۶:۴) و با به کارگیری رهیافت آزمون کرانه ها، الگوی چرخشی مارکوف و الگوی خودرگرسیون با وقفه های توزیعی است و نظریه کینزین های جدید مبنی بر نامتقارن بودن تاثیر شوک ها بر تولید مورد آزمون قرار گرفت. از این رو با بسط یک معادله مارکوف برای رشد نقدینگی، شوک های مثبت و منفی، کوچک و بزرگ برای اقتصاد ایران استخراج شدند، سپس با استفاده از الگوی خود رگرسیون با وقفه های توزیعی به بررسی نحوه تاثیر شوک های پولی بر تولید پرداخته شد. نتایج حاکی از آن است که در بلندمدت شوک های پولی کوچک و بزرگ (مثبت یا منفی) در اثرگذاری بر تولید ناتوان هستند که این به معنای خنثایی پول در بلندمدت است. اما در کوتاه مدت شوک های پولی تولید را تحت تاثیر قرار می دهند به نحوی که شوک های منفی در اثرگذاری بر شوک های مثبت قوی تر عمل می کنند و با لحاظ اندازه شوک ها، تاثیر شوک های منفی کوچک و شوک های منفی بزرگ به ترتیب بیشتر از تاثیر شوک های مثبت کوچک و شوک های مثبت بزرگ است. از سویی عدم تقارن بین شوک های کوچک و بزرگ پولی وجود دارد، زیرا شوک های کوچک مثبت و منفی به ترتیب نسبت به شوک های بزرگ مثبت و منفی، بیشتر تولید را تحت تاثیر قرار می دهند.

کلمات کلیدی:

شوک بزرگ، شوک کوچک، عدم تقارن، کینزین های جدید، تولید

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1267295>

