

عنوان مقاله:

گروه‌بندی دارایی‌های پولی در ایران بر اساس تحلیل ناپارامتریک تقاضای پول

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 52، شماره 4 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

نویسندگان:

علیرضا عرفانی - دانشیار دانشگاه سمنان

پرویز داودی - استاد گروه اقتصاد دانشگاه شهید بهشتی

فرزانه صادقی - دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه سمنان

خلاصه مقاله:

در میان اساسی‌ترین مفروضات موجود در اقتصاد خرد، حداکثرسازی مطلوبیت و تفکیک‌پذیری اقلام در تابع مطلوبیت مصرف‌کننده، به لحاظ نظری و نیز کاربرد تجربی، از مهم‌ترین آن‌ها به شمار می‌رود. هدف از این مقاله بررسی نتایج آزمون ناپارامتریک این مفروضات بر رفتار مصرف‌کننده، در مورد دارایی‌های پولی در ایران است. برای این منظور از رویکرد هال واریان با دو آزمون سازگاری با اصل حداکثرسازی مطلوبیت (GARP) و نیز آزمون تفکیک‌پذیری ضعیف بهره گرفته شده است. با استفاده از داده‌های ماهانه در بازه‌ی زمانی ۱۳۸۷:۱ تا ۱۳۹۱:۱۲، نتایج نشان می‌دهد که داده‌های دارایی‌های پولی، به دلیل وجود ۲ مشاهده‌ی نقض‌کننده‌ی اصل، به طور کلی سازگار با اصل حداکثرسازی مطلوبیت نمی‌باشد. لذا مطابق با روش استاندارد، دو زیرمجموعه‌ی زمانی ۱۳۸۷:۱ تا ۱۳۸۸:۱۲ و نیز ۱۳۸۹:۱ تا ۱۳۹۱:۱۲ مورد آزمون قرار گرفته و سازگاری آن‌ها بدون هیچ‌گونه نقضی مورد تایید قرار گرفته شده است. سپس آزمون تفکیک‌پذیری ضعیف تابع مطلوبیت در ۱۵ زیرگروه از دارایی‌های پولی مورد بررسی قرار دادیم. طبق نتایج شرط لازم و کافی تفکیک‌پذیری ضعیف در برخی از زیرگروه‌ها در بازه‌ی زمانی اول و دوم برقرار است، در نهایت این نتیجه حاصل می‌شود که بازه‌های زمانی‌ای وجود دارد که در آن در برخی از زیرگروه‌ها از دارایی‌های پولی، اگر فرم تابعی خاصی در ادبیات موضوع تقاضای پول رد می‌شود، به معنای رد تحلیل تقاضای پول مبتنی بر مطلوبیت نیست، بلکه به معنای رد تصریح خاص تابع و یا رد گروه خاص دارایی‌های پولی می‌باشد. طبقه بندی JEL: E۴۱، E۵۲

کلمات کلیدی:

تجمیع پولی، حداکثرسازی مطلوبیت، رویکرد ناپارامتریک، آزمون سازگاری با GARP، تفکیک‌پذیری ضعیف

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1308098>

