

عنوان مقاله:

اثر نامتقارن سیاست پولی بر تولید بخش صنایع و معادن در ایران: رهیافت همجمعی پنهان

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق)، دوره 13، شماره 3 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

نویسندگان:

زهرا طهماسبی - دانشجوی دکتری گروه اقتصاد دانشکده مدیریت و اقتصاد واحد علوم و تحقیقات دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

کامبیز هژبرکیانی - استاد گروه اقتصاد دانشکده مدیریت و اقتصاد واحد علوم و تحقیقات دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

محسن مهرآرا - استاد گروه اقتصاد دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران، تهران، ایران

بیژن صفوی - استادیار گروه اقتصاد واحد تهران جنوب دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

هدف اصلی در این پژوهش بررسی و آزمون آثار نامتقارن حجم نقدینگی بر تولید بخش صنایع و معادن است. برای این منظور از تحلیل های همجمعی پنهان و الگوی توزیع وقفه ای خود رگرسیون در اقتصاد ایران در دوره زمانی ۱۳۵۳ تا ۱۳۹۹ استفاده شده است. برای استخراج تکانه های مثبت و منفی متغیر حجم نقدینگی از فیلتر هودریک پرسکات استفاده شده است. سپس آثار تکانه های مثبت و منفی متغیرها به صورت جداگانه بر تکانه های مثبت و منفی تولید این بخش با تحلیل همجمعی پنهان بررسی شد. در مرحله آخر با استفاده از الگوی خودرگرسیونی با وقفه های توزیعی غیرخطی و آزمون کرانه ها رابطه بلندمدت بین متغیرها بررسی و ضرایب بلندمدت محاسبه شد. نتایج نشان داد که همجمعی پنهان بین سری های زمانی حجم نقدینگی و تولید در بخش صنایع و معادن وجود دارد، به طوری که اجزای مثبت حجم نقدینگی و تولید در این بخش با یکدیگر و همچنین اجزای منفی آنها نیز با هم رابطه بلندمدت دارند. همچنین اثر گذاری تکانه های مثبت حجم نقدینگی بزرگتر از تکانه های منفی این متغیر است. بنابراین وجود عدم تقارن در سیاست پولی مورد تایید قرار گرفت.

کلمات کلیدی:

حجم نقدینگی، همجمعی پنهان، الگوی خودرگرسیونی با وقفه های توزیعی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1777495>

