

عنوان مقاله:

بررسی اثرات اجزای بدهی دولت به بانکهای تجاری بر روی اجزای نقدینگی در اقتصاد ایران

محل انتشار:

فصلنامه مدل سازی اقتصاد سنجی، دوره 8، شماره 1 (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 42

نویسندگان:

دلنیا یادگاری - کارشناسی ارشد اقتصاد، گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و کارآفرینی، دانشگاه رازی

سهراب دل انگیزان - دانشیار اقتصاد، گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و کارآفرینی، دانشگاه رازی

آزاد خانزادی - استادیار اقتصاد، گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و کارآفرینی، دانشگاه رازی

خلاصه مقاله:

بدهی دولت به بانکهای تجاری می تواند از طریق تاثیر بر ترازنامه بانکهای تجاری و از آن طریق ترازنامه بانک مرکزی، روی پایه پولی و نقدینگی اثرگذار باشد. در اقتصاد ایران با وجود رشد ۶/۳۲ و ۹/۱۹ درصدی بدهی بخش دولتی به بانکهای تجاری در سال ۱۳۹۶ و ۱۳۹۷ که با ۱/۲۲ و ۱/۲۳ درصدی رشد نقدینگی همراه بوده است با بررسی اجزا این فرضیه شکل می گیرد که اجزای بدهی دولت به بانکهای تجاری می تواند روی نقدینگی و اجزای آن اثرگذار باشد. داده های مورد استفاده در این مطالعه از آمارهای رسمی بانک مرکزی ایران برای دوره های زمانی ۱۳۹۸-۱۳۷۷ به صورت فصلی اخذ شده اند. در این پژوهش سعی شده با استفاده از روش الگوی غیرخطی رگرسیونی با وقفه های توزیعی (NARDL) به بررسی اثرات اجزای بدهی دولت به بانکهای تجاری روی اجزای نقدینگی ایران به تفکیک مورد ارزیابی قرار گیرد. نتایج نشان می دهد که شوک های بدهی دولت به بانکهای تجاری در بلند مدت و کوتاه مدت اثر متقارنی بر پایه پول، پول، نقدینگی و شبه پول دارند؛ علاوه بر این شوک های بدهی شرکت ها و موسسات دولتی به بانکهای تجاری اثر نامتقارنی بر پایه پول، پول، نقدینگی و شبه پول دارند.

کلمات کلیدی:

بدهی دولت، نقدینگی، ایران، الگوی غیرخطی رگرسیونی با وقفه های توزیعی NARDL

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1777757>

