

عنوان مقاله:

تحلیلی از اثر تنزی و اثر ضدتنزی در اقتصاد ایران: رویکرد مبدل موجک گسسته و الگوی خودرگرسیون برداری آستانه ای

محل انتشار:

پژوهشنامه اقتصاد کلان، دوره 15، شماره 29 (سال: 1399)

تعداد صفحات اصل مقاله: 25

نویسندگان:

اعظم کاظم زاده - دانشجوی دکتری اقتصاد، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران

سعید کریمی پتانلار - دانشیار گروه اقتصاد، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران

احمد جعفری صمیمی - استاد گروه اقتصاد، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران

خلاصه مقاله:

تورم از دو طریق بودجهی دولت را تحت تاثیر قرار می‌دهد. تورم از یک سو قدرت خرید درآمدهای مالیاتی را کاهش می‌دهد که به اثر تنزی معروف است. از سوی دیگر، تورم بار ناشی از مخارج دولتی و تعهدات آن را به طور حقیقی کاهش می‌دهد که به اثر ضدتنزی شهرت پیدا کرده است. ضمناً، باید متذکر شد که تورم نیز از کسری بودجهی دولت تاثیر می‌پذیرد. در پژوهش حاضر با به کارگیری مبدل موجک گسسته با حداکثر هم‌پوشانی و الگوی خودرگرسیون برداری آستانه‌ای اثرات متقابل تورم و کسری بودجهی دولت در دو حالت کسری کل و کسری عملیاتی در اقتصاد ایران طی سال‌های ۱۳۹۶:۳ - ۱۳۹۹:۱ از زوایای جدیدی بررسی شده است. نتایج مبتنی بر مبدل موجک نشان می‌دهد در افق‌های بیش‌تر از ۸ سال رابطه‌ی علی میان هر دو نوع کسری بودجه با تورم دو طرفه است. بر اساس نتایج برآورد الگوی خودرگرسیون برداری آستانه‌ای، در تورم‌های فصلی کم‌تر از ۲۸/۶٪، کسری بودجهی کل در رویارویی با تکانه‌ی تورم افزایش شدیدی پیدا می‌کند. همچنین، کسری بودجهی عملیاتی قبل و بعد از آستانه واکنش مثبت به تکانه تورم نشان می‌دهد. با این توضیح که در نرخ‌های تورم فصلی فراتر از ۵۴/۲٪، شدت واکنش این متغیر بیش‌تر خواهد شد. به عبارتی همواره اثری تنزی قوی‌تر از اثر ضد تنزی است.

کلمات کلیدی:

کسری بودجه، تورم، مبدل موجک گسسته، الگوی خودرگرسیون برداری آستانه ای

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1852636>

