

عنوان مقاله:

آزمون خنثایی پول در کوتاهمدت و بلندمدت در اقتصاد ایران با تاکید بر تکانهای پولی: کاربردی از رهیافت آزمون کرانهها

محل انتشار:

دوفصلنامه اقتصاد پولی، مالی، دوره 23، شماره 11 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 37

نویسندگان:

حسن خداویسی - دانشیار اقتصاد، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه

احمد عزتی شورگلی - کارشناس ارشد اقتصاد، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه

خلاصه مقاله:

یکی از موضوعات بسیار مهم برای سیاست گذاران اقتصادی در سطح کلان، نحوه رفتار متغیرها در بلندمدت و کوتاهمدت در نتیجه تغییر پارامترهای سیاستی میباشد. از جمله پارامترهای مهم سیاست گذاری، ابزارهای سیاست پولی است که این مقاله بر آن تمرکز دارد. در حقیقت یکی از موضوعات مورد بحث در ادبیات اقتصاد نظری، نحوه تاثیر سیاست پولی و شوک های پولی بر متغیرهای واقعی است. این پژوهش به بررسی آزمون خنثایی پول و عدم تقارن تکانهای پولی در ایران، با استفاده از دادههای فصلی دوره زمانی 3:1393-1369:1 میپردازد. الگوی اقتصادسنجی به کارگرفته شده در این مقاله رهیافت آزمون کرانهها، روش فیلتر هدریک-پرسکات و مدل خودرگرسیون با وقفههای توزیعی است. نتایج حاصل نشان میدهد که پول در بلندمدت در اقتصاد ایران خنثی است، ولی در کوتاهمدت، رشد نقدینگی تولید را تحت تاثیر قرار میدهد. سپس با استفاده از روش فیلتر هدریک-پرسکات، شوک های مثبت و منفی پولی و ادوار تجاری اقتصاد ایران تفکیک میشوند. نتایج حاکی از آن است که شوک های پولی تاثیر نامتقارنی بر تولید دارد. همچنین اثر شوک های پولی بر تولید طی سیکل های تجاری نامتقارن است.

کلمات کلیدی:

خنثایی پول، تکانهای پولی، رهیافت آزمون کرانهها

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/588604>

