

عنوان مقاله:

بررسی اثر تکانه های نرخ سود تسهیلات بانکی بر تابع تقاضای پول در ایران با استفاده از الگوریتم جستجوی گرانشی و الگوریتم کرم شب تاب

محل انتشار:

کنفرانس بین المللی مدیریت، اقتصاد و علوم انسانی (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

احمد اسد زاده - دانشیار دانشگاه تبریز، دانشکده اقتصاد، مدیریت و بازرگانی، گروه اقتصاد، تبریز، ایران .

نینا میرانی - دانشجوی دکتری تخصصی اقتصاد دانشگاه تبریز، دانشکده اقتصاد، مدیریت و بازرگانی، گروه اقتصاد، تبریز، ایران

امین قاسمی نژاد - کارشناس ارشد اقتصاد دانشگاه شهید باهنر کرمان، دانشکده مدیریت، اقتصاد و حسابداری، گروه اقتصاد، کرمان، ایران.

خلاصه مقاله:

متغیرهای پولی همچون تقاضای پول و نرخ سود به عنوان مهمترین متغیر بازار داخلی و نرخ ارز به عنوان مهمترین متغیر بازار خارجی، نقش بسیار مهمی در نوسانات شرایط اقتصادی یک کشور ایفا می کنند. در این بین تاثیر تغییرات نرخ سود تسهیلات بانکی بر تقاضای پول از اهمیت بالایی برخوردار است. لذا در این مقاله ارتباط بین این متغیرها و تاثیر آن بر اقتصاد ایران در دوره 1350-1391 با تاکید بر نقش شرایط تورمی مورد تجزیه و تحلیل قرار گرفته است. در این تحقیق، به منظور بررسی تاثیر تکانه های نرخ سود بانک ها بر تابع تقاضای پول، با استفاده از الگوی GARCH تکانه های نرخ سود بانک ها استخراج گردید. سپس با استفاده از الگوریتم جستجوی گرانشی (GSA) و الگوریتم بهینه سازی کرم شب تاب (FA)، به برآورد تابع تقاضای پول در قالب معادلات غیر خطی پرداخته شده است. نتایج نشان از کشش مثبت تقاضای پول نسبت به متغیر تولید ناخالص داخلی به مقدار 0/4 دارد که این خود نظریه مکتب کمبریج را مورد تاکید قرار می دهد. همچنین نتایج حاکی از آن است که یک درصد کاهش در تکانه های نرخ سود تسهیلات بانکی باعث افزایش 0/3 درصد افزایش در تقاضا برای پول در اقتصاد ایران می گردد. علامت منفی ضرایب متغیرهای تکانه های نرخ سود، نرخ تورم و نرخ ارز تاکید بر نظریه بامول و توبین و نظریه معروف فریدمن است. همچنین نتایج مطالعه حاکی از آن است که تاثیر تکانه های نرخ سود تسهیلات بانکی بر تابع تقاضای پول در محیط های تورمی بالا و متوسط کمتر است.

کلمات کلیدی:

تقاضای پول، نرخ سود تسهیلات بانکی، مدل GARCH، الگوریتم جستجوی گرانشی، الگوریتم کرم شب تاب

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/625141>

