

عنوان مقاله:

بررسی رابطه پویا بین ادوار مالی با ادوار تجاری و شکاف تورم در ایران: کاربردی از تبدیل موجک

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 9، شماره 33 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

صالح طاهری بازخانه - دانشجوی دکتری علوم اقتصادی دانشگاه مازندران، مازندران، ایران

محمد علی احسانی - دانشیار دانشگاه مازندران، مازندران، ایران

محمدتقی گیلک حکیم آبادی - دانشیار دانشگاه مازندران، مازندران، ایران

خلاصه مقاله:

بحران مالی جهانی 2007 نشان داد ادوار مالی یکی از دلایل نوسانات اقتصاد کلان به شمار رفته و می تواند موجب ایجاد سیکل های تجاری شود. در صورت وجود چنین رابطه ای، اتخاذ واکنش سیاستی فعالانه برای هموارسازی ادوار مالی ضروری به نظر می رسد. در این راستا، پژوهش حاضر پویایی های رابطه بین ادوار مالی با ادوار تجاری و شکاف تورم را در اقتصاد ایران طی 1395:4 - 1369:1 بررسی می کند. برای این منظور، نخست یک شاخص وضعیت مالی برای اقتصاد ایران تدوین شده است. افزون بر این، با استفاده از آزمون علیت در دامنه فرکانس افق های قابل استفاده برای پیش بینی رشد اقتصادی با استفاده از شاخص مذکور مشخص شده است. در ادامه، برای بررسی هدف تحقیق و تحلیل در دامنه فرکانس و دامنه زمان - فرکانس، از ابزار جدید تبدیل موجک گسسته با حداکثر هم پوشانی و تبدیل موجک پیوسته استفاده شده است. نتایج نشان می دهد رابطه ادوار مالی و ادوار تجاری در کوتاه مدت و بلندمدت دو سویه بوده و شدیداً ناپایدار است. در میان مدت، ادوار تجاری متغیر پیشرو است اما حرکت فازی بین دو متغیر در دهه 1370 متفاوت از دهه 1380 می باشد. در کوتاه مدت، ادوار مالی و شکاف تورم رابطه ای دو سویه و ناپایدار را تجربه کرده اند. در میان مدت، ادوار مالی موجب فاصله گرفتن تورم از روند بلندمدت آن شده است. اما در بلندمدت و پس از سال 1386، این رابطه عکس شده است. با توجه به نتایج تحقیق، توصیه می شود سیاست گذار پولی علاوه بر هموارسازی تولید و تورم حول روند بلندمدت آنها، این مهم را برای بخش مالی نیز مدنظر قرار دهد تا دو هدف فوق در افق های گوناگون با خطای کم تری محقق شود.

کلمات کلیدی:

ادوار مالی، ادوار تجاری، شکاف تورم، تبدیل موجک گسسته با حداکثر هم پوشانی، تبدیل موجک پیوسته

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/885812>

