

بررسی رابطه علیت گرنجری بین تورم و کسری بودجه در ایران با استفاده از روش ARDL در دوره زمانی (۱۳۹۱-۱۳۵۸)

رضا محسنی*، رضا کریمی بابا احمدی^۲

۱- استادیار اقتصاد دانشگاه شهید بهشتی (نویسنده مسئول). re_mohseni@sbu.ac.ir

۲- دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد انرژی دانشگاه شهید بهشتی rezav0307@gmail.com

چکیده

کسری بودجه دولت و روش های تامین مالی آن بر متغیرهای کلان اقتصادی اثرات متفاوتی دارد. همچنین افزایش سطح عمومی قیمت ها (تورم) به عنوان پدیده ای تاثیرگذار در اقتصاد هر کشور بوده و اهمیت آن، سیاستگذاران و اقتصاددانان را بر آن داشته است تا به ریشه یابی و راههای معالجه آن بپردازند. در این مقاله، نحوه رابطه بین تورم و کسری بودجه را طی سال های (۱۳۵۸-۱۳۹۱) بررسی می کند و با استفاده از مدل وقفه توزیعی خود رگرسیونی^۱ (ARDL) وجود رابطه بلند مدت بین متغیرهای موجود مورد آزمون قرار می دهد و سپس با استفاده از روش حداقل مربعات معمولی^۲ به برآورد مدل و آزمون علیت گرنجر^۳ (رابطه علیت بین تورم و کسری بودجه) را طی دوره مطالعه، مورد آزمون قرار داده است. نتایج این مطالعه حاکی از این است که رابطه بلند مدت میان متغیرها وجود داشته و رابطه علیت از سوی تورم به کسری بودجه می باشد.

واژه های کلیدی: تورم، کسری بودجه، علیت گرنجر، مدل وقفه توزیعی خود رگرسیونی (ARDL)

۱- مقدمه

به طور کلی اقتصاددانان از نظر اجرای اهداف سیاست کلان اقتصادی، بر مواردی همچون اشتغال کامل، ثبات قیمت ها (کنترل تورم)، توزیع عادلانه درآمد و رشد اقتصادی تاکید دارند. برای رسیدن به اهداف که منجر به تعادل در اقتصاد کلان خواهد شد، دولت ها می باید توجه خود را معطوف به تخصص بهینه بودجه نمایند. (Fischer et al, ۲۰۰۲)

نتایج تحقیقات انجام شده حاکی از گسترش عوامل موثر بر تورم در اقتصاد کشور است که مهمترین این عوامل عبارتند از: تامین کسری بودجه دولت، افزایش قیمت حامل های انرژی و حذف یارانه های صنعتی و صنفی پس از اجرای سیاستهای تعدیل، افزایش ریسک مربوط به فعالیتهای مولد اقتصادی، ضعف در مدیریت مخصوصا مدیریت ارز و کاهش ارزش پول و بالاخره افزایش قیمت های جهانی.

با توجه به اینکه تورم مزمن پدیده ای نسبتا بلند مدت در اقتصاد ایران بوده و بالا گرفتن نرخ تورم در سالهای اخیر، یکی از اساسی ترین مشکلات کشور است، لذا همواره مطالعاتی در زمینه عوامل موثر در ایجاد این پدیده مورد نیاز می باشد.

^۱. Auto-Regressive distributed Lags Model (ARDL)

^۲. Ordinary Least Squares (OLS)

^۳. Granger Causality Test