



آزمون جانیشینی پول در ایران: کاربرد ی از الگوی خود بازگشتی باوقفه های توزیعی (ARDL)

رضا همتی^۱*

* کارشناسی ارشد دانشگاه جامع امام حسین (ع)

چکیده

اتخاذ سیاست های پولی و مالی مناسب در اقتصاد هر کشور، منوط به اطلاع از شکل تابع تقاضای پول آن کشور است. از این رو، شناخت صحیح این تابع و متغیرهای مهم تاثیرگذار بر آن، می تواند زمینه لازم را برای به کارگیری موفقیت آمیز سیاست های اقتصادی فراهم کند. هدف از این مطالعه، بررسی رفتار متغیرهای تاثیرگذار بر تقاضای پول در دوره ۱۳۹۳-۱۳۶۵ در اقتصاد ایران است که برای دستیابی به این هدف، از روش خودبازگشتی باوقفه های توزیعی ARDL استفاده شده است. نتایج به دست آمده بیانگر وجود یک رابطه تعادلی بلند مدت بین تقاضای پول و متغیرهای تولید ناخالص داخلی، نرخ تورم، نرخ سود سپرده های بانکی و نرخ ارز است. همچنین جانیشینی پول در کوتاه مدت و بلند مدت مورد تایید قرار گرفته است که در بلند مدت شدت آن بیشتر از کوتاه مدت است. این تحقیق نشان داد که اثر مستقیم در آمد و تاثیر غیر مستقیم نرخ واقعی سود سپرده های بانکی و نرخ تورم بر تقاضای پول، در بلند مدت بیشتر از کوتاه مدت هستند.

واژه های کلیدی: جانیشینی پول، تقاضای پول، الگوی خود بازگشتی باوقفه توزیعی، نرخ اسمی ارز، نرخ تورم.

طبقه F31، C22، E41، E31:JEL