



روابط ساختاری بین ذخایر پولی ایران و تورم با استفاده از الگوی VAR

مهدی مرادی^۱، جعفر یوسفی^۲

۱- استادیار گروه علوم اقتصادی، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران

۲- دانشجوی دکتری دانشگاه آزاد اسلامی، واحد میانه، گروه اقتصاد، آذربایجان شرقی، ایران

چکیده

در دهه گذشته با پیشرفت تورم در اقتصاد شاهد توجه هر چه بیشتر به روابط بین ذخایر پولی و تورم در حوزه اقتصاد هستیم. در این پژوهش از شاخص قیمت مصرف کننده (CPI) به عنوان یکی از مهمترین شاخصه‌ها برای محاسبه‌ی میزان تورم استفاده می‌کنیم. و گردش پول M0، محاسبات محدود M1، محاسبات گسترده M2، شاخص قیمت مصرف کننده را به صورت داده‌های ماهیانه به عنوان نمونه انتخاب می‌کنیم و بردار خودهمبسته (VAR) را ایجاد می‌کنیم. همچنین برای عملکرد واکنش‌های لحظه‌ای و تجزیه واریانس از الگوهای اقتصادسنجی استفاده خواهیم کرد. در نهایت هم پول در گردش M0، محاسبات محدود M1، محاسبات گسترده M2 و روابط بین شاخص قیمت مصرف کننده CPI و میزان تأثیرات مختلف بر تورم را در ارتباط با ذخایر پولی مشخص می‌کنیم. برای مطالعه تجربی این الگو از داده‌های اقتصاد کشور در دوره زمانی ۱۳۸۷ تا ۱۳۹۷ استفاده کردیم. **واژگان کلیدی:** بردار خودهمبسته، علیت گرنجر، آزمون ایستایی و تابع واکنش تکانه‌ای طبقه‌بندی JEL: E51, E52, E31