

به نام خدا

**نقش تکانه‌های اقتصادی
در الگوهای اقتصاد کلان باز جدید**

رو به الونژادنوری

کاسپین دانش

۱۳۹۷

سرشناسه	: بالونژاد نوری، روزبه، ۱۳۵۹-
عنوان و نام پدیدآور	: نقش تکرانه‌های اقتصادی در الگوهای اقتصاد کلان باز جدید/روزبه بالونژاد نوری.
مشخصات نشر	: قزوین: کاسپین دانش، ۱۳۹۷.
مشخصات ظاهری	: ۱۵۶ ص: جدول، نمودار.
شابک	: 978-600-8572-22-0
وضعیت فهرست نویسی	: فیبا
یادداشت	: کتاینامه.
موضوع	: تورم — ایران — سیاست دولت
موضوع	: Inflation (Finance) -- Government policy -- Iran
موضوع	: سیاست پولی — ایران
موضوع	: Monetary policy -- Iran
موضوع	: نفت — جنبه‌های اقتصادی
موضوع	: Petroleum -- Economic aspects
موضوع	: ایران — سیاست اقتصادی
موضوع	: Iran -- Economic policy
رده بندی کنگره	: H۳۹۷۲/۱۲۲۰ ب۲/۳
رده بندی دیویی	: ۹۵۵
شماره کتابشناسی ملی	: ۵۰۴۵۷



نقش تکرانه‌های اقتصادی در الگوهای اقتصاد کلان باز جدید

مؤلف: روزبه بالونژاد نوری

ناشر: کاسپین دانش

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۸۵۷۲-۲۲-۰

نوبت چاپ: اول، ۱۳۹۷

قیمت: ۳۲۰۰۰ تومان

مرکز پخش: قزوین، بلوار نخبگان، دانشگاه آزاد اسلامی قزوین، مجتمع تجاری، مرکز تخصصی

کتاب علامه جعفری تلفن: ۰۲۸-۳۳۶۸۱۰۵۸

کلیه حقوق چاپ و نشر برای ناشر محفوظ است.

فهرست مطالب

۵	پیشگفتار.....
۱۳	فصل اول: درخصوص تکانه‌ها اقتصادی مروری بر دیدگاه‌های مختلف.....
۱۳	۱-۱ مروری بر دیدگاه‌های مختلف اقتصاد پولی.....
۱۴	۱-۱-۱ رویکرد کلاسیک‌ها.....
۱۵	۱-۱-۲ رویکرد کینزی‌ها.....
۱۷	۱-۱-۳ پول‌گرایی و نظریه مقداری جدید.....
۲۰	۱-۱-۴ کلاسیک‌های جدید.....
۲۲	۱-۱-۵ نظریه تور تئوری حقیقی.....
۲۶	۱-۱-۶ کینزی‌ها، جدید.....
۳۰	۱-۲ مجاری اثرگذاری سیاست پولی در اقتصاد.....
۳۷	۱-۳ اثر تکانه فناوری در اقتصاد.....
۳۸	۱-۴ اثر تکانه قیمت و درآمد نفت بر تولید و تورم.....
۴۴	۱-۴-۱ تکانه عرضه و تقاضای نفت.....
۴۶	۱-۴-۲ تکانه قیمت نفت، رابطه مبادله و بازار ارز.....
۴۷	۱-۵ اثر تکانه مخارج دولت.....
۵۱	۱-۶ اقتصاد کلان باز جدید.....
۵۲	۱-۶-۱ الگوی پایه آسفلد و روگوف.....
۵۵	۱-۶-۲ اقتصاد باز کوچک.....
۵۸	۱-۷ الگوسازی اثر تکانه‌های اسمی و واقعی در چارچوب اقتصاد باز کوچک.....
۵۹	۱-۷-۱ خانوارها.....
۶۳	۱-۷-۲ تورم داخلی، تورم شاخص قیمت کالاهای مصرفی و رابطه مبادله.....
۶۵	۱-۷-۳ تسهیم ریسک بین المللی.....
۶۶	۱-۷-۴ تولید.....

- ۶۷ ۱-۷-۵ فرآیند تعیین قیمت
- ۶۸ ۱-۷-۶ تقاضای کل و تولید
- ۶۹ ۱-۷-۷ هزینه نهایی و پویایی های تورم در یک اقتصاد باز کوچک
- ۷۰ ۱-۷-۸ پویایی های تعادل
- ۷۱ ۱-۷-۹ پویای های تعادل در شرایط وجود قاعده نرخ بهره
- ۷۳ فصل دوم مروری بر الگوهای جدید پولی و کاربرد آن در اقتصاد ایران
- ۷۳ ۲-۱ انواع الگوهای پولی در چارچوب الگوهای DSGE
- ۷۳ ۲-۱-۱ الگوی پولی یک
- ۹۸ ۲-۲ بررسی اقتصاد ایران در چارچوب یک الگوی اقتصاد باز
- ۹۸ ۲-۲-۱ بررسی داده های تولید تورم در اقتصاد ایران
- ۱۲۲ ۲-۲-۳ حل الگو
- ۱۲۸ ۲-۲-۵ مقداردهی و شبیه سازی الگو
- ۱۲۹ منابع و مآخذ

پیش گفتار

در اقتصاد پولی، روابط بین متغیرهای اسمی و واقعی مورد بررسی قرار می‌گیرند. بین شاخص‌های اقتصادی که در ارزیابی عملکرد اقتصادی استفاده می‌شوند، تولید به عنوان یک معیار واقعی و تورم به عنوان یک متغیر اسمی، از اهمیت بیشتری برخوردار هستند. از جمله دلایل این امر می‌توان به وسعت دامنه اثرگذاری و اثرپذیری متغیرهای فوق از سایر متغیرهای اقتصادی اشاره کرد. به همین دلیل، بررسی اثرات سیاست‌های پولی بر تولید و تورم بخش قابل توجهی از مطالعات اقتصادی را به خود اختصاص داده است. در خلال نیم قرن اخیر، علاوه بر توسعه مبانی نظری روش‌های آماری و محاسباتی ارزیابی سیاست‌های پولی نیز تکامل یافتند. برای بررسی اثرات سیاست‌های پولی بر متغیرهای فوق، روش‌های گوناگونی وجود دارد که از آن جمله می‌توان به روش‌های اقتصادسنجی از جمله الگوهای خودرگرسیون برداری^۱ (VAR) اشاره کرد. هدف از آرایه این الگوها، از بین بردن ابهامات در پیش‌بینی‌های اقتصادی و بررسی پایداری اثرگذاری تکانه‌ها بر متغیرهای اقتصادی است. با این حال، با وجود شکل‌گیری و معرفی الگوهای جدید اقتصادسنجی که از پیچیدگی‌های بیشتری نیز برخوردار هستند، در عمل، هزینه و تحلیل‌ها و پیش‌بینی‌ها به درستی صورت نمی‌گرفتند. انتقادهای وارده به الگوهای متعارف کلان‌سنجی، در اواسط دهه ۱۹۷۰ و همزمان با بروز پدیده تورم رکودی آغاز گردید. اولین گروه

از انتقادهای وارد به الگوهای متعارف کلان سنجی، توسط سیمز^۱ (۱۹۷۲) مطرح گردید. سیمز در واقع انتقادی نظری را به این الگوهای وارد کرد و در نقد خود، نحوه به‌کارگیری برخی از متغیرهای برون‌زا را در حل الگوها، مورد توجه قرار داد. در ادامه، لوکاس^۲ (۱۹۷۶) انتقادهای جدیدی را به الگوهای فوق مطرح کرد. در این انتقاد، لوکاس نحوه استفاده از تحلیل‌های حاصل از نتایج الگوها، در تعیین سیاست‌های اقتصادی را مورد توجه و نقد قرار داد. لوکاس معتقد بود در صورتی که کارگزاران بخش خصوصی اقتصاد، بر اساس بهینه‌سازی پویا رفتار کرده و از اطلاعات کامل و انتظارات عقلایی برخوردار باشند، در پاسخ به اتخاذ یک سیاست اقتصادی، رفتار ثابت در نظر گرفته شده خود را تغییر خواهند داد. به عبارت دیگر لوکاس نشان داد که تغییرات در سیاست‌ها، بر رفتار کارگزاران اقتصادی تأثیر گذار بوده و صرفاً به نسبت به تغییرات سیاستی بدون تغییر نیستند. در پاسخ به انتقاد لوکاس^۳، کیدلند و پرسکات^۴ (۱۹۸۲) برای برطرف کردن انتقاد لوکاس، الگوهای تعادل عمومی پویای تصادفی (DGE) را معرفی کردند که در آن، معادلات پایه‌های اقتصاد خردی را همراه با محدودیت‌های لازم دارند. به عبارت دیگر، در این‌جا معادلات ناشی از بهینه‌سازی رفتار کارگزاران اقتصادی، به‌عنوان قیودها است. همچنین، در صورتی که الگوی مورد نظر به درستی تصریح شده باشد، الزامی به ساختاری، در تغییرات سیاستی بدون تغییر باقی می‌ماند. می‌توان کاربرد الگوهای DGE در حوزه اقتصاد کلان را به دو دسته عمده تقسیم کرد. گروه اول، نظریه دور تجاری حقیقی (RBC) هستند.

^۱ Sims

^۲ Lucas

^۳ Lucas Critique

^۴ Kydland and Prescott

^۵ Dynamic Stochastic General Equilibrium (DSGE)

^۶ Real Business Cycle (RBC)