دانشگاه تهران

دانشكده اقتصاد

پايان نامه كارشناسي ارشد

عنوان:

برآورد تابع تقاضا براي پول در اقتصاد ايران

نگارش: زهرا سلطاني خانگهدائي

استاد راهنما: منصور خليلي عراقي

سال تحصيلی: ۱۳۷۲

زبان : فارسي

بر ساخت: ۲۹۳ص.: ٤٧ كتابنامه

توصيفگر

۱. تئوري مقداري پول

۲. تئوري كينز

۳. تقاضا براي پول از ديدگاه فريدمن

٤. مدلهاي تقاضا براي پو.ل در سطح خرد

۵. اندازه گيري پول

٦. متغير هاي مستقل : ثروت و درآمد , متغير هاي هزينه فرصت

۷. مدل تعديل كامل

۸. مدل تعديل جزيي

۹. مدل وقفه آلمون

چكيده :

در كشورهاي در حال توسعه مطالعات زيادي جهت شكل مناسب تابع تقاضا براي پول انجام گرفته است. به علت متفاوت بودن ساختار اين كشور ها از كشورهاي پيشرفته در رابطه با انتخاب متغير هزينه فرصت مناسب در تابع تقاضا براي پول مشكلاتي وجود دارد. در اين كشور ها بازار پول رسمي كوچك ناقص و ناكارآ است. نرخ بهره وامهها و سپرده هاي بانكها معمولا تحت كنترل بوده و گوياي نرخ بهره واقعي بازار پول نمي باشد. همچنين در اين گونه كشورها در كنار بازار رسمي يك بازار غير رسمي پول نيز وجود دارد كه نرخ هاي اين بازار مبين نرخ بهره حقيقي بازار پول مي باشد. اما معمولا اين نرخها ثبت شده و در دسترس نيست بعضي از محققان كه در رابطه با تابع تقاضاي پول در كشورهاي درحال توسعه كار كرده اند عقيده دارند كه به علت ثبات نرخ بهره بانكي و در دسترس نبودن نرخ بهره بازار غير رسمي مي توان متغير نرخ بهره را از تابع تقاضا براي پول اين كشورها حذف نمود. اگر چه ظاهرا ممكن است اين عقده درست به نظر برسد اما حذف يك متغير موثر از مدل اثرات مخربي بر روي ضرايب برآورد شده خواهد داشت. با توجه به موارد بالا در اين پايان نامه به برآورد تابع تقاضا براي پول ايران در دوره ۷۰-۱۳٤۰ مي پردازيم. هدف از اين مطالعه مشخص نمودن عوامل موثر در تابع تقاضا براي پول در ايران , تعيين مناسبترين تعريف پول از نظر تجربي و بررسي اين فرضيه است كه متغير هاي جايگزين نرخ بهره در تابع تقاضا براي پول ايران نقش دارند. نظر به اينكه در ايران نيز مانند ساير كشورها ي در حال توسعه نرخ سود(بهره) در بازار رسمي (بانكها) كنترل شده بوده و در كنار بازار رسمي پول, بازار غير رسمي متشكل از افراد , سلف خرها .و ..... و در دوره بعد از انقلاب صندوقهاي قرض الحسنه , شركتهاي مضاربه اي و ... وجود داشته است, همچنين تقريبا در سراسر دوره مورد بررسي از ابزار با معرفي تعدادي از متغيرهاي جايگزين نرخ بهره كه براي كشورهاي در حال توسعه پيشنهاد شده است نقش آنها را به همراه متغيرهاي توليد ناخالص داخلي و نرخ تورم در تابع تقاضا براي پول ايران در سه مدل تعديل كامل , تعديل جزيي و وقفه آلمون و براي تعريف محدود حجم پول در و سپس حجم نقذينگي مورد بررسي قرار داده و بر اساس اهميت آماري ضرايب متغير اي مذكور و خوبي برازش خط رگرسيون نسبت به موثر بودن آنها قضاوت خواهد شد.