

عنوان مقاله:

اثر شاخص شرایط مالی بر متغیرهای کلان اقتصادی در ایران: رهیافت TVP-FAVAR

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 13، شماره 50 (سال: 1402)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

عاطفه اله وردی - دانشجوی دکتری علوم اقتصادی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران

سعید دائی کریم زاده - گروه علوم اقتصادی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران

سارا قبادی - گروه علوم اقتصادی، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران

خلاصه مقاله:

در سالهای اخیر، شاخص شرایط مالی (FCI) در بسیاری از کشورها به عنوان یک شاخص مهم جهت مشخص کردن وضعیت سیاست های کلان اقتصادی مورد استفاده قرار گرفته است؛ به همین منظور، در مطالعه حاضر اثرات شاخص شرایط مالی بر متغیرهای کلان اقتصادی با به کارگیری الگوی خود توضیح برداری عامل افزوده شده با پارامترهای متغیر زمانی (TVP-FAVAR) و با استفاده از دادههای فصلی طی دوره (۱۳۷۰-۱۳۹۸) مورد بررسی و تحلیل قرار گرفته است. نتایج حاصله بیانگر آن است که نوع واکنش و میزان واکنش متغیرهای کلان اقتصادی نسبت به تکانه شاخص شرایط مالی در گذر زمان متفاوت بوده است و این امر لزوم به کارگیری رهیافت پارامتر - متغیر را آشکار میسازد. براساس نتایج بدست آمده، متغیرهای نرخ بیکاری و نرخ رشد اقتصادی در کوتاه مدت و بلندمدت به ترتیب واکنش منفی و مثبتی به تغییرات رفتاری متغیر شاخص شرایط مالی نشان دادهاند؛ اثرات تکانه شاخص شرایط مالی بر متغیر نرخ تورم بعد از یک دوره نمایان گشته؛ اما بااین حال واکنش این متغیر به تکانه شاخص شرایط مالی در کوتاه مدت و بلندمدت با توجه به شرایط حاکم بر اقتصاد کشور متفاوت بوده است؛ همچنین تکانه شاخص شرایط مالی در کوتاه مدت باعث بهبود متغیر ضریب جینی شده، اما در بلندمدت به ویژه در سال های اواخر دهه ۱۳۹۰ باعث افزایش شکاف درآمدی شده است؛ واکنش متغیر کسری بودجه به تکانه شاخص شرایط مالی در کل دوره مورد بررسی مثبت بوده و تکانه شاخص شرایط مالی باعث افزایش کسری بودجه دولت شده است.

کلمات کلیدی:

شاخص شرایط مالی، متغیرهای کلان، خودتوضیح برداری عامل افزوده شده با پارامترهای زمانی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1777480>

