

## عنوان مقاله:

اندازه گیری اثرات شوک سیاست پولی در ایران: رویکرد خودتوضیح برداری عامل تعمیم یافته (FAVAR)

## محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد مقداری، دوره 11، شماره 1 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

## نویسنده:

جلیل خدایرست شیرازی - هیئت علمی دانشگاه آزاد اسلامی شیراز

## خلاصه مقاله:

هدف از این مطالعه بررسی اثرات سیاست پولی بر متغیرهای اقتصاد کلان ایران بوده است. در این راستا با استفاده از روش شناسی نسبتا جدید الگوهای خودتوضیح برداری عامل تعمیم یافته (FAVAR) و بهره گیری از داده های فصلی سری زمانی ۱۱۰ متغیر اقتصاد کلان ایران طی دوره ۱۳۶۹:۱-۱۳۹۱:۴، سیاست های پولی مورد ارزیابی قرار گرفته شده است. جهت ارزیابی سیاست های پولی، با توجه به اجرای قانون بانکداری بدون ربا، بجای نرخ بهره از چهار متغیر حجم نقدینگی، پایه پولی، بدهی بانک ها به بانک مرکزی و اعتبارات اعطایی سیستم بانکی به بخش خصوصی، به عنوان ابزار پولی استفاده شده است. نتایج نشان می دهد اثر سیاست پولی بر تولید در کوتاه-مدت چندان روشن نیست اما خنثایی پول در بلندمدت را می توان پذیرفت. ضمن آنکه اجرای سیاست پولی انبساطی اثر پایداری بر سطح عمومی قیمت ها داشته و در کوتاه-مدت و بلندمدت منجر به افزایش تورم شده است. مقایسه نتایج دو الگوی VAR و FAVAR و استفاده از الگوی FAVAR جهت ارزیابی اثر سیاست های پولی نشان می-دهد، معمای قیمت در اقتصاد ایران بوجود نیامده است.

## کلمات کلیدی:

الگوی خودتوضیح برداری عامل تعمیم یافته (FAVAR)، الگوی عامل پویا، سیاست پولی، مولفه اصلی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1821019>

