

عنوان مقاله:

بررسی اثر شوک های پولی بر 12 گروه اصلی شاخص بهای کالاها و خدمات مصرفی با استفاده از روش FAVAR

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 16، شماره 49 (سال: 1390)

تعداد صفحات اصل مقاله: 35

نویسندگان:

مریم همتی - کارشناس ارشد پژوهشی گروه پولی و ارزی پژوهشکده پولی و بانکی بانک مرکزی

احمدرضا جلالی نایینی - مدیر گروه پولی و ارزی پژوهشکده پولی و بانکی

خلاصه مقاله:

دستیابی به سطوح قابل قبولی از رشد قیمت ها یکی از وظایف و همچنین هدف های سیاستگذاران اقتصادی به ویژه در بانک های مرکزی است به منظور اجرای سیاست کنترل تورم اطلاعات مربوط به نحوه واکنش قیمت ها به سیاست های پولی برای سیاستگذاران پولی از اهمیت ویژه ای برخوردار است مطالعات بیساری در رابطه با این پرسش که قیمت ها در پاسخ به شوک های پولی چه واکنشی دارند واکنش سطح کلی قیمت ها مانند شاخص قیمت مصرف کننده CPI یا شاخص تعدیل کننده مصرف را بررسی می کنند در اندک مطالعاتی که تاکنون در زمینه تحلیل اثر شوک های پولی بر قیمت های جزیی انجام گرفته از الگوهای خودرگرسیون برداری استفاده شده است نتایج این مطالعات نشان دهنده افزایش برخی قیمت های جزیی در پاسخ به سیاست پولی انقباضی است این نتیجه که در تناقض با تیوری رایج اقتصادی است در ادبیات به معمای قیمت معروف است در این مطالعه به منظور بررسی اثر شوک های پولی بر سطح قیمت ها رویکرد متفاوتی اتخاذ گردیده است با استفاده از روش FAVAR واکنش پیاپی 12 گروه اصلی شاخص قیمت کالاها و خدمات مصرفی در اثر شوکی به اندازه یک انحراف معیار نرخ رشد پایه پولی با استفاده از توابع واکنش آلی مورد بررسی قرار گرفته است نتایج حاصل از توابع واکنش آلی به این شرح استنباط می شود 1: شوک پولی اثر تاخیری بر روی قیمت های جزیی دارد و بیشتر قیمت با تاخیر قابل توجهی به شوک پولی واکنش نشان می دهند 2: تفاوت های محسوسی در بین واکنش قیمت گروههای مختلف وجود دارد این در حالی است که بنابر فواصل اطمینان به دست آمده از روش تخمین دو مرحله ای معنی داری این تفاوت ها از لحاظ آماری مورد تایید قرار نگرفته است

کلمات کلیدی:

تحلیل عاملی، تحلیل مولفه های اصلی، شوک پولی، چسبندگی قیمت ها، پایداری تورم، قیمت های جزیی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/682224>

