

## عنوان مقاله:

آیا نااطمینانی تورمی با سطح تورم تغییر می کند؟

## محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 41، شماره 2 (سال: 1385)

تعداد صفحات اصل مقاله: 18

## نویسنده:

احمد تشکینی - دانشجوی دکتری (Ph.D) اقتصاد دانشگاه تهران و پژوهشگر دفتر مطالعات اقتصادی

## خلاصه مقاله:

هدف این مطالعه آزمون این فرضیه است که نااطمینانی تورم در سطوح بالاتر تورم افزایش می یابد. این تحلیل براساس مدل های واریانس ناهمسانی شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته (GARCH)، که این امکان را فراهم می کند تا واریانس شرطی جمله خطا در طول زمان تغییر کند، استوار است. از آنجایی که این واریانس به عنوان جانشینی برای نااطمینانی تورم است، ارتباط مثبت بین واریانس شرطی و تورم به عنوان شاهدهی بر این که نااطمینانی تورم همراه با سطح تورم افزایش می یابد، تفسیر می شود. یافته ها نشان می دهد که تورم علت نااطمینانی تورم است (به عبارتی رابطه مثبت و معناداری بین تورم و نااطمینانی تورم وجود دارد). برطبق این نتایج، بانک مرکزی می تواند با اعمال سیاست های ضدتورمی در جهت کاهش نااطمینانی تورم گام بردارد. طبقه بندی JEL: P24, E31.

## کلمات کلیدی:

تخصیص منابع، تورم، مدل واریانس ناهمسانی شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته، نااطمینانی تورم، نااطمینانی رژیم

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1309799>

