

## عنوان مقاله:

بررسی اثر فیشر با استفاده از فیلتر کالمن با وجود شکست ساختاری

## محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد کاربردی، دوره 7، شماره 21 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 11

## نویسنده:

بهاره معدنیان - کارشناس ارشد بانک کشاورزی

## خلاصه مقاله:

نرخ بهره و تورم از متغیرهای مهم اقتصادی در جامعه می باشند. با توجه به اهمیت ارتباط این دو متغیر، در این مقاله با استفاده از داده های سالانه ۱۳۵۷ تا ۱۳۹۰ وجود اثر فیشر بین نرخ تورم و نرخ بهره کوتاه مدت، یک ساله، سه ساله و پنج ساله بررسی شده است. با توجه به وجود شکست ساختاری در داده ها برای بررسی پایایی متغیرها از آزمون های ریشه واحد با شکست ساختاری مثل زیووت-اندریو و پرون و برای بدست آوردن بردار همجمعی با شکست ساختاری نیز از آزمون گریگوری-هانسن استفاده شد. از فیلتر کالمن نیز برای بدست آوردن پارامتر پویای اثر فیشر بهره گرفته شد. نتایج نشان داد که نرخ بهره کوتاه مدت داری اثر فیشر بوده و دیگر نرخ بهره ها دارای ارتباط بلند مدت نمی باشند. لذا پیشنهاد می شود، تعیین نرخ بهره با توجه به نیاز جامعه و اهداف اقتصادی صورت گیرد.

## کلمات کلیدی:

سطح عمومی قیمت، آزمون زیووت-اندرسون، آزمون پرون، آزمون گریگوری-هانسن، الگوی فضا-حالت

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1324588>

