

## عنوان مقاله:

پویابیهی تورم و رابطه تورم و عدم اطمینان اسمی با استفاده از الگوی ARFIMA-GARCH

## محل انتشار:

فصلنامه پژوهشنامه اقتصادی، دوره 10، شماره 36 (سال: 1389)

تعداد صفحات اصل مقاله: 34

## نویسندگان:

تیمور محمدی - استادیار دانشکده اقتصاد - دانشگاه علامه طباطبائی

رضا طالبو - دانشجوی دکتری دانشکده اقتصاد - دانشگاه علامه طباطبائی

## خلاصه مقاله:

در این تحقیق به بررسی پویابیهی تورم و استخراج رابطه تورم و عدم اطمینان تورمی پرداخته شده تا بدین وسیله نشان داده شود که در اقتصاد ایران چه رابطه ای بین این دو متغیر وجود دارد. برای این منظور از داده های سری زمانی ماهیانه دوره زمانی ۸۳-۶۹ استفاده شده است. در ابتدا برای اینکه تمامی آثار قابل پیش بینی را از سری تورم کسر نماییم، از مدل بندی سری های زمانی استفاده شده است. برای تعیین این مدل در وهله اول، آزمون دیکی فولر تعمیم یافته، فیلیپس پرون و KPSS انجام شده از این آزمونها نتیجه گرفتیم که درجه انباشتگی باید بین صفر و یک باشد. و بدین ترتیب فرضیه حافظه دار بودن سری تورم مطرح شد و نشان داده شد که سری تورم دارای درجه انباشتگی حدود ۴/۰ است و بطور کلی نتیجه گرفته شد که سری تورم اقتصاد ایران دارای حافظه بلند مدت (همبستگی بلند مدت) است و آثار هر تکانه بر این سری تا دوره های طولانی باقی می ماند. در مرحله بعد مقادیر جزء خطا در معادله (ARFIMA) با استفاده از مدل مولفه ای نامتقارن GARCH مورد بررسی قرار گرفت و مشاهده شد که اثرات نامتقارن در شوک های تورمی وجود دارد و واکنش تورم در مواجهه با شوک های منفی و مثبت به یک اندازه نیست. نتایج آزمون علیت نیز نشان می دهد که جهت علیت دو طرفه است؛ یعنی هم عدم اطمینان بر تورم اثر می گذارد و هم تورم باعث عدم اطمینان می شود.

## کلمات کلیدی:

ایران، تورم، عدم اطمینان تورمی، مدل ARFIMA، مدل مولفه ای نامتقارن GARCH، آزمون KPSS، آزمون فرضیه حافظه بلند مدت، مدل اقتصادسنجی، شاخص CPI

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1409900>

