

عنوان مقاله:

رابطه میان تورم و نااطمینانی تورم

محل انتشار:

اولین همایش بین المللی اقتصاد سنجی، روشها و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 23

نویسندگان:

عذرا محمدی - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه شهید چمران (نویسنده مسئو

حسن فرازمنند - دانشیار دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی دانشگاه شهید چمران اهواز

عذرا بیاتی - دانشجوی کارشناسی ارشد علوم اقتصادی دانشگاه اصفهان

خلاصه مقاله:

بررسی تورم از موضوعات مهم در حوزه سیاستگذاری و برنامه ریزی اقتصاد ملی هر کشور است. بررسی نظری و تجربی تورم نان می دهد، تورم بعنوان متغیر هدف، تحت تأثیر عوامل زیادی قرار دارد که بسیاری از آنها قابل شناسایی و اندازه گیری انفرادی نیستند. بنابراین، تفکیک اثر جمعی این گونه عوامل به عنوان متغیرهای غیر قابل کنترل از متغیرهای کنترل مهم است. بدین منظور این مقاله رابطه تورم و نااطمینانی تورم را در ایران با استفاده از مدل‌های GARCH و داده های ماهیانه 1369-1390 (از فروردین 1369 تا اسفند 1390) بررسی می کند. ابتدا مدل تورم و نااطمینانی در چارچوب الگوهای گارچ تصریح شده، سپس الگوی اقتصاد سنجی با استفاده از نرم افزار Eviews.6 برآورد گردید و نتایج کمی رابطه بین تورم و نااطمینانی تورم بررسی می شود. نتایج نشان می دهد که نااطمینانی در چارچوب شوکهای مثبت و منفی دارای اثرات نامتقارن بوده و اثر اهرمی در اقتصاد ایران وجود دارد. همچنین، نتایج آزمون علیت گرنجری نشان می دهد که تورم، علیت گرنجری نااطمینانی تورم در اقتصاد ایران بوده ولی عکس آن برقرار نیست.

کلمات کلیدی:

تورم، نااطمینانی تورم، واریانس ناهمسانی شرطی خود رگرسیون تعمیم یافته، مدل‌های GARCH

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176244>

