

عنوان مقاله:

بررسی اثرات متغیر زمانی تعیین کننده های تورم: مدل های فضا حالت

محل انتشار:

فصلنامه مدل سازی اقتصادی، دوره 9، شماره 30 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

محسن خضری - دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس

بهرام سحابی - استادیار اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس

کاظم یآوری - دانشیار اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس

حسن جیدری - استادیار اقتصاد دانشگاه تربیت مدرس

خلاصه مقاله:

چکیده با توجه به اهمیت تورم در اقتصاد ایران بررسی دقیق تعیین کننده های تورم از اهمیت بالایی برخوردار است. بر اساس نتایج مطالعات مختلف، ارزیابی تعیین کننده های تورم با استفاده از الگوی VAR استاندارد، به دلیل تورش متغیرهای حذف شده در الگوی VAR، به نتایج نادرستی منتهی می شود؛ به عنوان نمونه می توان به مشکل معمای قیمت در ادبیات تجربی اشاره کرد. در این تحقیق جهت بررسی دقیق تر تعیین کننده های تورم در اقتصاد ایران و پیش بینی تورم، به جای مدل VAR با ضرایب ثابت، با استفاده مدل های TVP-VAR، اقدام به مدل سازی تورم شده است، به طوری که متغیرهای رشد تولید ناخالص داخلی، رشد پایه پولی، تورم، نرخ ارز، نرخ سود بانکی و نااطمینانی تورم وارد مدل شده اند. نتایج حقیق حاضر بیانگر تغییر روابط بین متغیرهای فوق در طول زمان می باشد و اثرگذاری شرایط حاکم بر اقتصاد کشور را در نحوه اثرگذاری متغیرهای مدل بر یکدیگر نشان می دهد.

کلمات کلیدی:

طبقه بندی C₅₃، C₁₁، E₃₇، E₃₁، JEL: واژگان کلیدی: خودرگرسیون، تورم، مدل های فضا-حالت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1863239>

