

عنوان مقاله:

برآورد تابع تقاضای برق خانگی دارای پارامتر متغیر طی زمان (TVP) رهیافت فضا-حالت

محل انتشار:

دوفصلنامه سیاست گذاری پیشرفت اقتصادی، دوره 4، شماره 1 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 22

نویسندگان:

تیمور محمدی - معاون آموزشی دانشگاه علامه طباطبایی

مرتضی خورسندی - استادیار دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبایی

شهاب الدین فولادی مقدم - دانشجوی کارشناسی ارشد دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبایی

خلاصه مقاله:

کشش های قیمتی، متقاطع و درآمدی تقاضای برق، مبنایی بسیار مهم برای سیاستگذاری و پیش بینی هستند. مطالعات انجام شده، عموماً این کمیت های مهم اقتصادی را طی زمان ثابت فرض کرده اند، در حالی که پارامترهای مولد این کمیت ها ممکن است طی زمان بی ثبات باشند. در این صورت، کشش های محاسبه شده به دلیل خطای تصریح [1]، اریب دار و ناسازگار خواهند بود. در این مقاله، تلاش شده ضمن اجرای آزمون هانسن [2] در رد ثبات پارامترها، به روش فیلتر کالمن در قالب مدل فضا-حالت، کشش های قیمتی، درآمدی، دما و متقاطع تقاضا ارائه شود؛ بنابراین، ضمن رفع آسیب های مدل های رایج، به تخمین کشش های تقاضا می پردازیم. کشش های تابع تقاضای برق خانگی در ایران برای سال های 90-1349 برآورد شده اند. داده های استفاده شده در این مقاله، عبارتند از: مصرف برق سرانه، قیمت واقعی برق، درآمد سرانه، دما و قیمت واقعی بنزین به عنوان نماینده انرژی های جانشین برای برق در بخش خانگی. نتایج نشان می دهد کشش های قیمتی، درآمدی و دما برای تقاضای برق خانگی در طول زمان در حال تغییر هستند [3] (TVP). همچنین می توان بعضی جهش ها را در این کشش ها در طول زمان مشاهده کرد؛ به طوری که قدر مطلق کشش قیمتی در سال 58 جهش افزایشی داشته که می تواند ناشی از افزایش درآمد های نفتی و افزایش تقاضا باشد و در دوران جنگ نیز مجدداً می توان فشار روی تقاضا را مشاهده کرد. کشش درآمدی نیز ابتدا در سال 52 یک جهش افزایشی داشته و بعد از آن، کاهش یافته و به روند با ثبات تری رسیده است. و همین طور کشش دما نیز از سال 58 به بعد، یک جهش به سمت بالا را تجربه کرده است. [1].
Misspecification [2]. Hansen Test [3]. Time Varying Parameter

کلمات کلیدی:

فضا-حالت، تقاضای برق، سری زمانی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/872219>

