

عنوان مقاله:

بررسی پویایی رابطه علیت بین قیمت مصرف کننده و قیمت تولید کننده در ایران: کاربرد تبدیل موجک پیوسته

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 20، شماره 62 (سال: 1394)

تعداد صفحات اصل مقاله: 27

نویسندگان:

فیروز فلاحی - دانشیار گروه اقتصاد دانشگاه تبریز

حسین اصغر پور - دانشیار گروه اقتصاد دانشگاه تبریز

سجاد عبدالله زاده - دانش آموخته کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه تبریز

خلاصه مقاله:

در این مطالعه از رهیافت تبدیل موجک پیوسته جهت بررسی پویایی رابطه علیت بین دو شاخص اصلی تورم یعنی شاخص قیمت مصرف کننده CPI و شاخص قیمت تولید کننده PPI برای اقتصاد ایران طی دوره زمانی 1369.2-1392.9 استفاده شده است مطالعه پویایی رابطه علیت بین شاخص های کلیدی تورم می تواند نتایج راه گشایی جهت تدوین سیاست های کنترل نرخ تورم به همراه داشته باشد در حالی که روش های سنتی بررسی علیت بیشتر به آزمون مقطعی رابطه علیت پرداخته و توضیح چندانی درباره پویایی آن بین شاخص های قیمت نمی دهند مبدل های موجک با قابلیت بالای خود در تحلیل پویایی روابط علی بین سری های زمانی این کاستی را پاسخ می دهند در این روش از آنجا که طول موجک به طور بهینه در مقیاس های مختلف زمانی تغییر می کند امکان بررسی همزمان علیت کوتاه مدت و علیت بلند مدت بین سری های زمانی اقتصادی در فضای همبستگی موجک فراهم می شود در این تحقیق نتایج به دست آمده از کاربرد تبدیل موجک پیوسته در مطالعه ادوار تورمی اقتصاد ایران تاثیر گذاری هر دو اثر جاذبه تقاضا و فشار هزینه در شکل گیری علیت تورمی دو طرفه بین شاخص های CPI و PPI را نشان می دهد به نحوی که با افزایش مقیاس زمان ماندگاری جهت رابطه علیت بیشتر بوده است

کلمات کلیدی:

تورم، شاخص قیمت مصرف کننده، شاخص قیمت تولید کننده، رهیافت موجک

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/682313>

