



اندازه گیری اثر شوک قیمتی انرژی (نفت) بر نرخ تورم در ایران

سید صفدر حسینی و مرتضی تهامی پور

به ترتیب استاد و دانشجوی دکتری اقتصاد کشاورزی، دانشکده اقتصاد و توسعه کشاورزی، دانشگاه تهران

hosseini_safdar@yahoo.com mortezatahamipour@yahoo.com

واژه‌های کلیدی: قیمت نفت- نرخ تورم- درجه انتقال- منحنی فیلیپس- ایران.

چکیده

در این مطالعه اثر شوک های قیمت نفت بر تورم در کوتاه مدت و بلندمدت در ایران طی دوره زمانی ۸۶-۱۳۶۹ اندازه گیری شده است. در این راستا، ابتدا ضرایب انتقال قیمت نفت به تورم در کوتاه مدت و بلندمدت با استفاده از برآورد منحنی فیلیپس با داده های فصلی محاسبه گردید و پایداری این ضرایب با آزمون شکست ساختاری بررسی شد. سپس تغییرات تدریجی انتقال قیمت نفت به تورم در طول زمان با استفاده از رگرسیون متغیر با زمان اندازه گیری گردید و در نهایت عوامل موثر بر میزان انتقال قیمت نفت به تورم بررسی شد. نتایج نشان داد که ضریب انتقال قیمت نفت به تورم در بلندمدت حدود ۳۸ درصد و ضریب انتقال متغیر با زمان کوتاه مدت حدود ۸/۶ درصد می باشد. نتایج بررسی عوامل موثر بر اثر شوک قیمت نفت به تورم نشان داد که مدیریت صحیح درآمدهای مازاد نفتی، بهبود سیاستهای پولی کشور و تهیه زیر ساخت های مناسب برای افزایش قدرت رقابت تولید کنندگان داخلی می تواند برای پیش گیری از اثر های تورمی شوک های نفتی مفید باشد.

۱- مقدمه

بررسی اثر شوک های نفتی بر متغیر اقتصادی نرخ تورم، در اقتصاد بسیار مهم است. درک ارتباط دقیق و کمی بین قیمت های نفت و نرخ تورم برای سیاست گذاری اقتصادی در زمینه کاهش نرخ تورم و کنترل اثر شوک های نفتی بسیار حائز اهمیت است. مطالعات انجام شده نشان می دهد که اثر های تورمی شوک های قیمت نفت در کوتاه مدت کوچک است بطوریکه گراسیا و کانادو^۱ (۲۰۰۵) در پژوهشی برای ۶ کشور آسیایی طی دوره ۱۹۷۵:۱ تا ۲۰۰۲:۲ نشان دادند که قیمت های نفت اثر معنی داری روی شاخص های قیمت مصرف کننده دارد و این اثر در کوتاه مدت کوچک است. چاین و لی بلانک^۲ (۲۰۰۴) در پژوهشی نشان دادند که افزایش قیمت نفت به طور نسبی اثر کوچکی روی تورم آمریکا، ژاپن و کشورهای اروپایی داشته است. بنابراین با افزایش قیمت نفت، درصدی از این افزایش در اثر عوامل مختلف به نرخ تورم در اقتصاد منتقل می شود که علیرغم کوچک بودن این اثر در کوتاه مدت، اثر آن معنی دار است چنانچه تاسکی و برومنت^۳

¹ Gracia and Canada

² Chinn and Le Blanc

³ Tasci and Berument