

Zaman Ortamında Sektörel Enflasyon Direnci Hesaplaması: Türkiye Örneği

Özet

Bu çalışmada Türkiye 1988:02 - 2007:10 aylık genel ve sektörel fiyat serilerinden yararlanarak enflasyon dirençleri seviyeleri üç yöntemle incelenmektedir. Bu yöntemler: statik beklentilere dayalı stokastik süreç modeli, yapısal kırılma ve zamana bağlı değişen ortalamadır. Elde edilen sonuçlara göre sektörel enflasyon direnci Türkiye'de ele alınan dönemde farklılık göstermektedir. Enflasyon direnci seviyesinin yüksek olmasına rağmen ortalamasına geri döndüğü tespit edilmiştir.

Anahtar Kelimeler: *Enflasyon direnci, zaman ortam, makroekonomi.*

Estimating Sectoral Inflation Persistency in Time-Domain: An Application for Turkey

Abstract

In this study, by using the Turkish aggregated and sectoral price monthly data for the period 1988:02 – 2007:10, inflation persistency levels were analysed by three methods. These methods are stockhastic model based on the static expectations, structural break and time varying mean models. According to the results obtained from these models, the inflation persistency levels exhibit diversification in Turkey during the period that we considered. Although the inflation persistency level is high, we observed that there is a case of mean reversion.

Keywords: *Inflation persistency, time domain, macroeconomics.*

Afşin ŞAHİN¹
Murat ÇETİNKAYA²

¹ Dr., Avrupa Birliği Uzmanı, T.C. Tarım ve Köyişleri Bakanlığı Dış İlişkiler ve Avrupa Birliği Koordinasyon Dairesi Başkanlığı,

afsinsahin@gmail.com

² Yrd. Doç. Dr., Selçuk Üniversitesi İİBF İktisat Bölümü,

mcetinkaya@selcuk.edu.tr