

pesquisa na fea – Economia



Curva de Phillips de informação rígida com inatenção variante no tempo

HENRIQUE DANYI DA SILVEIRA CORREIA

Dissertação de Mestrado

Orientador(es): Rodrigo de Losso da Silveira Bueno

Ricardo Dias de Oliveira Brito - (Coorientador).

Banca: Rodrigo de Losso da Silveira Bueno, (Presidente), Eurilton Alves Araujo Junior, Osmani Teixeira de Carvalho Guillén, Márcio Issao Nakane

Link: <https://doi.org/10.11606/D.12.2023.tde-05052023-203019>

Resumo

A persistência inflacionária é um tópico de grande relevância para as discussões de política macroeconômica. A Curva de Phillips de Informação Rígida (SIPC) incorpora a persistência inflacionária de maneira microfundamentada como resultado de inatenção por parte das firmas. Análises empíricas anteriores da SIPC estimaram a inatenção como constante no tempo, mas esse não é necessariamente o caso. Nós revisamos o modelo canônico da SIPC para permitir uma inatenção variante no tempo e apresentamos evidência empírica que apoia essa característica. Nós também encontramos que a inatenção no modelo da SIPC está fortemente associada à volatilidade da inflação, como previsto por Reis (2006a).