

## عنوان مقاله:

تعبین ادوارونق و رکود اقتصاد ایران با استفاده از مدل مارکوف سوئیچینگ

## محل انتشار:

سومین کنفرانس بین المللی چشم اندازهای نوین در حسابداری، مدیریت و کارآفرینی (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

## نویسندگان:

مجتبی قنبری مروست - کارشناسی ارشد مهندسی مالی، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی

حمیدرضا تیو - کارشناسی ارشد حسابداری، دانشگاه شهید بهشتی

بهمن مظفری - کارشناسی ارشد مهندسی صنایع-سیستمهای اجتماعی و اقتصادی، دانشگاه صنعتی خواجه نصیرالدین طوسی

## خلاصه مقاله:

مدلهای مارکوف سوئیچینگ با توجه به اینکه کدام قسمت مدل اتورگرسو وابسته به رژیم باشد و تحت تأثیر آن انتقال یابد به انواع مختلف طبقه‌بندی میشوند. آنچه در مطالعات اقتصادی بیشتر مورد توجه است شامل چهار حالت مدلهای مارکوف سوئیچینگ میانگین، عرض از مبدأ، پارامترهای اتورگرسو و ناهمسانی واریانس می باشد. با توجه به این واقعیت که بر اساس نظریه های اقتصادی و مشاهدات تجربی برخی از متغیرهای اقتصادی دارای رفتار غیرخطی هستند، پژوهش حاضر با استفاده از مدلهای یاد شده سعی بر این دارد که اینگونه متغیرها را به صورت غیرخطی مدلسازی کند. با توجه به نتایج به دست آمده ادوارتجاری در ایران بر نوسان بوده و میانگین دوره های باقی ماندن در رونق و رکود بسیار کوتاه است. مهمترین تأثیر منفی نا اطمینانی اقتصادی کلان، بر سرمایه گذاری خصوصی است بنابراین، اتخاذ سیاست های مناسب اقتصادی از جانب دولت و بانک مرکزی در زمینه کاهش نوسانات اقتصادی و در نتیجه کاهش نا اطمینانی در اقتصاد کلان میتواند اثرات نامساعد بر سرمایه گذاری خصوصی را که خود متغیری بر نوسان است بزداید.

## کلمات کلیدی:

اقتصاد کلان، رکود اقتصادی، رونق اقتصادی، مدل مارکوف سوئیچینگ، مدل اتورگرسو.

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1120815>

