

عنوان مقاله:

مدلسازی با متغیرهای دوره تناوبی مختلط: مروری بر روش های گسترش یافته اخیر در اقتصادسنجی سری های زمانی

محل انتشار:

فصلنامه برنامه ریزی و بودجه، دوره 24، شماره 2 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 29

نویسندگان:

ناصر خیابانی - Faculty of Economics, Allameh Tabataba'i University, Tehran. Iran

فاطمه رجبی - Allameh Tabataba'i University, Tehran. Iran

خلاصه مقاله:

پژوهش‌های اقتصادسنجی نظری جدید بر این واقعیت متمرکز هستند که دوره تناوبی متفاوتی در سری های زمانی وجود دارند. این گروه از پژوهش ها به واسطه این که بر نقش اطلاعات در مدلسازی های اقتصادی تاکید می کنند، اهمیت قابل توجهی دارند. در رویکرد رایج سری های زمانی، برای فراهم شدن امکان مدلسازی اقتصادی متغیرها با تواتر متفاوت، تجمیع زمانی را به یک دوره تناوب یکسان تبدیل می کنند. این کار یعنی، تجمیع زمانی متغیرهایی با دوره تناوب متفاوت به از بین رفتن اطلاعات موجود در سری زمانی با تواتر بالاتر منجر می شود. پژوهش‌های دوره تناوب مختلط با ارائه راهکاری در جهت الگوسازی با متغیرهای دوره تناوب متفاوت، نیاز به تجمیع زمانی را در مدلسازی مرتفع می کنند. به ویژه این که نتیجه اصلی این شاخه از پژوهش های اقتصادی قدرت توضیح دهندگی بیش تر، پیش بینی بهتر، و کارایی بیش تر در الگوهای مبتنی بر سری های زمانی با تواتر متفاوت است. از این رو، تلاش می شود که با مروری بر پژوهش های پیشین پیشرفت ها و کاستی های شاخه جدید اقتصادسنجی شناخته شود.

کلمات کلیدی:

Mixed Frequency Data, Temporal Aggregation, Time Series, Efficiency, MIDAS Regression

داده های دوره تناوبی مختلط، تجمیع زمانی، سری های زمانی، کارایی،

رگرسیون MIDAS.

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1194040>

