

عنوان مقاله:

مقایسه عملکرد روش های مختلف پیش بینی شاخص قیمت تولیدکننده در ایران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق), دوره 10, شماره 4 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 48

نویسندگان:

فاطمه فهیمی فر - دانشجوی دکتری اقتصاد دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

تیمور محمدی - دانشیار گروه اقتصاد دانشکده اقتصاد دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

شاخص های اقتصاد کلان یکی از ابزارهای ضروری به منظور تعیین آثار سیاست های اقتصادی، برنامه ریزی ها و سیاستگذاریهای کوتاه مدت، میان مدت و بلندمدت برای یک اقتصاد است. یکی از شاخص های مهم در این زمینه شاخص قیمت تولیدکننده است. از این رو این مقاله به بررسی پیشبینی شاخص قیمت تولیدکننده در ایران با استفاده از دادههای سری زمانی فصلی در دوره زمانی ۱۳۶۹-۹۶ با استفاده از روشهای گزینشیمودن و متوسطگیری الگوی پویا در سه افق پیشبینی (یک، چهار و هشت فصل) میپردازد. در این گونه روشها نه تنها ضرایب بلکه الگوهای پیشبینی نیز در طول زمان تغییر میکنند. الگوهای مورد استفاده در این مطالعه به سه طیف، بزرگ مقیاس (شامل ۱۰۱ متغیر در نه بلوک عاملی)، متوسط مقیاس (شامل ۶ متغیر) و الگوهای تک متغیره دسته بندی شده اند. نتایج مطالعه نشان می دهد که پیشبینی الگوهای گزینشیمودن و متوسطگیری الگوی پویا نسبت به سایر رویکردهای در نظرگرفته شده در این مقاله، دارای عملکرد پیشبینی بهتری برای شاخص قیمت تولیدکننده در ایران هستند.

کلمات کلیدی:

الگوی عاملی، فضای-حالت، پیشبینی، شاخص قیمت تولیدکننده

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1267206>

