

## عنوان مقاله:

ریسک‌گریزی و چرخه‌های تجاری در اقتصاد ایران

## محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی ( اقتصاد سابق), دوره 10, شماره 2 (سال: 1398)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

## نویسندگان:

مهدی امینی راد - دانشجوی دکتری دانشکده علوم اقتصادی و اجتماعی دانشگاه بوعلی سینا، همدان، ایران

نادر مهرگان - استاد گروه اقتصاد دانشکده علوم اقتصادی و اجتماعی دانشگاه بوعلی سینا، همدان، ایران

ابوالفضل شاه آبادی - استاد گروه اقتصاد دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی، دانشگاه الزهراء، ایران

داود جعفری سرشت - استادیار گروه دانشکده علوم اقتصادی و اجتماعی دانشگاه بوعلی سینا، همدان، ایران

## خلاصه مقاله:

ترجیحات افراد نسبت به ریسک یکی از متغیرهای مهم اقتصادی بوده و تاثیر بسیاری در تصمیمات اقتصادی دارد. تصمیمات سرمایه‌گذاری، مصرف، پس‌انداز، خرید بیمه و قراردادهای آتی از جمله تصمیماتی هستند که ترجیحات ریسک در آن نقش کلیدی را بازی می‌کند. با توجه به اهمیت ترجیحات ریسکی در فرآیند تصمیم‌گیری، محاسبه شاخصی که بتواند به نحوی وضعیت گرایش ریسک در کل اقتصاد را نشان دهد، ضروری است. هدف از این پژوهش، برآورد سری زمانی پارامتر ریسک‌گریزی در اقتصاد ایران بر اساس اطلاعات فصلی طی دوره ۱۳۹۶-۱۳۸۱ است. به این منظور از الگوی گارچ در میانگین با پارامترهای متغیر طی زمان استفاده شد. نتایج برآورد ریسک‌گریزی در اقتصاد ایران نشان داد، این پارامتر در اقتصاد ایران ثابت نبوده و طی دوره ی مورد بررسی بین ۸۱/۰ تا ۶/۷ در نوسان بوده است. همچنین نتایج پژوهش نشان داد، ریسک‌گریزی در دوره ی رونق نسبت به رکود به مراتب پایین‌تر بوده و رفتار ضدچرخه ای دارد.

## کلمات کلیدی:

پاداش ریسک، چرخه‌های تجاری، ریسک‌گریزی، فیلتر کالمن

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1267230>

