

عنوان مقاله:

پیش بینی نرخ تورم ماهانه: کاربرد الگوی تصحیح خطای داده های ترکیبی با تواتر متفاوت

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق), دوره 7, شماره 27 (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 16

نویسندگان:

محمد نوفرستی - گروه اقتصاد، دانشکده علوم اقتصادی و سیاسی، دانشگاه شهید بهشتی

محبوبه بیات - کارشناس ارشد اقتصاد دانشکده علوم اقتصادی و سیاسی دانشگاه شهید بهشتی

خلاصه مقاله:

در مقاله حاضر به منظور پیش بینی نرخ تورم ماهانه با استفاده از داده های سری زمانی نمونه گیری شده باتواترهای متفاوت، از الگوی تصحیح خطای میداس استفاده شده است. برای بررسی دقت پیش بینی الگو، نرخ تورم ماه های مهر و آبان سال ۱۳۹۵ در الگو مورد استفاده قرار نگرفته و مقادیر تورم این دو ماه پیش بینی شده است. سپس به وسیله داده های هفتگی منتشر شده از متغیرهای توضیح دهنده، مقادیر این پیش بینی ها مورد تجدید نظر واقع شده است. در عین حال الگو برای ماه آذر ۱۳۹۵، یعنی آخرین ماهی که تا زمان تدوین این مقاله نرخ تورمی از سوی بانک مرکزی برای آن گزارش نشده است، یک پیش بینی اولیه و سه تجدید نظر با توجه به اطلاعات منتشر شده جدید انجام شده، و در نهایت این نرخ برابر ۸/۸ پیش بینی شده است.

کلمات کلیدی:

الگوی تصحیح خطا، پیش بینی، تورم ماهانه، الگوی داده های ترکیبی با تواتر متفاوت، میداس

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1301507>

