

## عنوان مقاله:

بکارگیری نمای لیپانوف برای مدل سازی سری زمانی قیمت نفت بر پایه توابع پویا

## محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 41، شماره 5 (سال: 1385)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

## نویسندگان:

علی معینی - استادیار گروه علوم پایه مهندسی دانشکده فنی دانشگاه تهران

حمید ابریشمی - استاد دانشکده اقتصاد - دانشگاه تهران

مهدی احراری - کارشناس ارشد اقتصاد

## خلاصه مقاله:

به کارگیری سیستم های غیرخطی پویا در تحلیل سری های زمانی اقتصادی، مدت هاست که مورد توجه اقتصاددانان قرار گرفته است. سیستم های غیرخطی پویا، رفتارهای مختلفی را از خود بروز می دهند، که می تواند در توجیه بسیاری از پدیده های اقتصادی که به نظر تصادفی می آیند، به کار گرفته شود. در این مقاله، راهکاری ارائه شده است، که براساس آن می توان تابع پویای خاصی را برای مدل سازی سری زمانی مفروضی به کار گرفت. ابتدا بزرگترین نمای لیپانوف با ابعاد محاط برای سری زمانی محاسبه و با تطابق آن با نمای لیپانوف تابع پویا، پارامتر کنترل کننده تابع، تخمین زده می شود. در این مقاله، از تابع لجستیک برای مدل سازی قیمت روزانه نفت در بازه زمانی ۲۰۰۰-۱۹۹۸، استفاده شده است. تابع لجستیک حاصل، برای پیش بینی قیمت در روندهای مختلف به کار گرفته شده است. نتایج به دست آمده از دقت بالایی برخوردار است. به محض آن که بتوان تابع پویا را به سری زمانی مفروضی برازش کرد، رفتارهای غیرخطی این تابع، می تواند در تحلیل عملکرد سری زمانی، امکان زیادی را در اختیار تحلیل گر اقتصادی قرار دهد. طبقه بندی JEL : C۵۳ , C۵

## کلمات کلیدی:

آشوب، تابع لجستیک، سری زمانی، سیستم های پویا، قیمت نفت، نمای لیپانوف

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1309765>

