

عنوان مقاله:

تحلیل سیکل های تجاری ایران با استفاده از نظریه موجک ها

محل انتشار:

فصلنامه تحقیقات اقتصادی، دوره 41، شماره 4 (سال: 1385)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

حسین عباسی نژاد - دانشیار دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران

شاپور محمدی - استادیار دانشکده مدیریت دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

تجزیه سری های زمانی به سیکل های مختلف و تحلیل آن ها در دامنه زمان و فراوانی اغلب با استفاده از روش های اقتصادسنجی سری زمانی و سری های فوریه انجام می پذیرد. علاوه بر این روش ها، فیلترهایی مانند فیلتر هودریک-پرسکات، باکستر-کینگ و کریستیانو-فیتزجرالد، برای تجزیه سری های زمانی در اقتصاد به کار گرفته می شوند. در این جا، از روش دیگری به نام نظریه موجک ها که توانایی تجزیه سری های زمانی با مقیاس های مختلف را دارد، به منظور تجزیه تولید ناخالص داخلی ایران استفاده می کنیم. نتایج نشان می دهند که روش موجک در شرایط تغییرات هموار سری های زمانی، تفاوت زیادی با روش هودریک-پرسکات ندارد و برای تشخیص سیکل ها در سری های زمانی با تغییرات ناگهانی، بهتر از روش های دیگر عمل می کند. هم چنین تحلیل موجک، علاوه بر سیکل ها، اطلاعات بیشتری در اختیار قرار می دهد. نتایج تجزیه تولید ناخالص داخلی ایران با استفاده از تبدیل موجک، نشان می دهند که ۸ سیکل ۱۶-۳۲ فصلی و ۱۴ سیکل ۸-۱۶ فصلی وجود دارد. هم چنین تحلیل نوسان نشان می دهد که تغییر زیادی در واریانس ضرایب موجک در دوران پیش از جنگ با جنگ وجود ندارد اما در دوران پس از جنگ، نوسان تولید ناخالص داخلی افزایش یافته است. طبقه بندی JEL: C۱۴, C۲۲, C۱۹, E۳۲

کلمات کلیدی:

پرسکات، تحلیل فوریه، سری های زمانی، سیکل های تجاری، فیلتر باکستر، فیلتر هودریک، کینگ، نظریه موجک ها

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1309773>

