

## عنوان مقاله:

پیش بینی نقدینگی بر اساس برآورد نقطه ای و بازه ای روش آریمای و مقایسه آن با روش هموارسازی نمایی دوگانه

## محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد مالی، دوره 11، شماره 40 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 17

## نویسندگان:

جعفر احمدی شالی - استادیار گروه آمار دانشگاه تبریز، تبریز، ایران

مهدی وصفی - دانشجوی کارشناسی ارشد آمار ریاضی دانشگاه تبریز، گروه آمار، تبریز، ایران.

## خلاصه مقاله:

موسسات مالی و اعتباری خصوصا بانکها اهمیت آن دو چندان می شود از این رو تعیین و تخمین شاخص نقدینگی کشور از اهمیت خاصی برای دولت و بانکها برخوردار است. به سبب اهمیت بالای تعیین نقدینگی و به منظور تصمیم سازی مناسب برآورد و پیش بینی آن در ماهها و سالهای آتی از ضروریات می باشد. ساختار نرم افزارهای تحلیلی مورد استفاده در اکثر مقالات طوری بوده که عملا تحلیلها در جعبه سیاه انجام شده است. در این تحقیق برای آنکه محقق مستقیما در فرآیند تحلیل قرار گیرد از نرم افزار توانمند R استفاده شده است. در این تحقیق در کنار برآورد نقطه ای که ممکن است با تغییراتی که صورت می پذیرد تفاوت معنی داری داشته باشد، از برآورد بازه ای نیز استفاده شده است. فاصله اطمینانهای ۸۰ و ۹۵ درصدی برای پیش بینی نقدینگی کشور انجام شده است که مقادیر واقعی نقدینگی را تحت پوشش قرار می دهند و برآورد مناسبی را در اختیار مدیران کلان قرار داده تا به هنگام برنامه ریزی مسائل اقتصادی در زمینه نقدینگی تغییرات ممکن را به شکل مناسبی لحاظ نمایند. نتایج حاصل از این تحقیق حاکی از آن هست که مدل آریمای پیشنهاد شده (نقطه ای- بازه ای) در مقایسه با روش هموارسازی نمایی دوگانه توانایی بالایی برای مدل سازی و پیش بینی میزان نقدینگی کشور را داراست.

Liquidity management is one of the most important tasks of financial management in firms and credit institutions. The importance of liquidity is to determine appropriate decision-making process in financial activities to decrease Risk and Uncertainty. Based on point estimation and interval estimation we analyzed changes in liquidity management with significantly different estimation. The results of this study suggest that ARIMA model coefficient compared to high capacity double exponential smoothing method for modeling and forecasting liquidity in the financial market is more suitable and consistent.

## کلمات کلیدی:

نقدینگی، پیش بینی آینده، مدل هموارسازی نمایی دوگانه، مدل آریمای، نرم افزار R، برآورد نقطه ای، برآورد بازه ای. طبقه بندی G<sub>1</sub>، G<sub>2</sub>، E<sub>3</sub>، C<sub>3</sub>: JEL

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1570242>

