

عنوان مقاله:

پیش بینی ادوار تجاری کشور ایران: رویکرد مدل زنجیره های مارکوف

محل انتشار:

اولین همایش بین المللی اقتصاد سنجی، روشها و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

مهدی فاضل - دانشجوی کارشناسی ارشد توسعه اقتصادی و برنامه ریزی- دانشگاه آزاد اسلام

اکبر توکلی - دانشیار اقتصاد- دانشگاه صنعتی اصفهان

خلاصه مقاله:

دسترسی به یک مدل اقتصاد سنجی با حداقل خطا در پیش بینی نوسانات متغیرهای کلان اقتصادی، نظیر تولید ناخالص داخلی، همواره مورد نظر برنامه ریزان اقتصادی بوده تا سیاستگذاران اقتصادی را قادر سازد بر اساس آن دورنمای بهتری از رفتار آتی متغیر در اختیار داشته باشند. تحقیق حاضر نیز با هدف معرفی مدل جدیدی از زنجیره های مارکوف موسوم به MS-AR بنا شده است تا به پی بینی ادوار تجاری جامعه ایران پرداخته شود. داده های مورد استفاده فصلی، از (1)1367 تا (4)1389 و از بانک مرکزی کشور گردآوری گردیده است. از دو مدل MS-AR و ARIMA جهت پی بینی رفتار ادوار تجاری بهره گیری شده است. ن تایج تحقیق نشان می دهد که مدل MS-AR در مقایسه با مدل ARIMA دارای عملکرد بهتری در پیش بینی ادوار تجاری می باشد.

کلمات کلیدی:

ادوار تجاری، مدل MS-AR، مدل ARIMA، پیش بینی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176162>

