

عنوان مقاله:

مروری بر الگوهای مارکوف سویچینگ و کاربردهای آن در اقتصاد

محل انتشار:

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

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

علی حسین صمدی - استادیار بخش اقتصاد دانشگاه شیراز، شیراز، ایران

پریسا بهلولی - دان

نگار سنگ سفیدی - دانشجوی کارشناسی ارشد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات فارس

خلاصه مقاله:

روش رایج برای مطالعه رفتار پویای متغیرهای کلان اقتصادی، استفاده از مدل های خطی سری زمانی می باشد. گرچه این مدل ها در بسیاری از موارد موفق عمل نموده اند ولی در توضیح رفتارهای غیر خطی ناتوان هستند. واریانس ناهمسانی شرطی خود رگرسیونی تعمیم یافته (GARCH) یکی از مدل های غیر خطی است که جهت برآورد ناطمینانی مورد استفاده قرار می گیرد. اغلب مدل های غیر خطی به اندازه کافی انعطاف پذیر نمی باشند به طوری که تغییرات و شکست های ساختاری را در نظر نمی گیرند. مدل مارکوف سویچینگ توسط همیلتون 1989 مطرح و به نام مدل تغییر رژیم نیز شناخته می شود. این مدل از مشهورترین مدل های سری زمانی غیر خطی می باشد که رفتار متغیرها را در رژیم های مختلف توضیح می دهد. در این مقاله گونه های مختلف مدل های مارکوف سویچینگ از قبیل MSARCH, MSVAR, MSAR و ... توضیح داده می شود و سپس به طور خاص به بررسی مدل MS-GARCH پرداخته می شود. هدف اصلی این مقاله، معرفی کامل روش MS-GARCH و مقایسه ی تکنیکی آن با مدل GARCH می باشد.

کلمات کلیدی:

نااطمینانی، مدل ناهمسانی واریانس شرطی تعمیم یافته، انتقال رژیم

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/176210>

