

عنوان مقاله:

ارزیابی عملکرد شاخص شرایط مالی در پیش بینی متغیرهای کلان اقتصادی ایران؛ رهیافت الگوهای پارامتر متغیر زمانی

محل انتشار:

پژوهشنامه اقتصاد کلان، دوره 16، شماره 32 (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 29

نویسندگان:

عاطفه اله وردی - دانشجوی دکتری، گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران،

سعید دائی کریم زاده - دانشیار، گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران

سارا قبادی - استادیار، گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران

خلاصه مقاله:

امروزه در بسیاری از کشورهای جهان، شاخص شرایط مالی به عنوان ابزاری برای پیش‌بینی متغیرهای کلان اقتصادی معرفی شده است. به همین منظور در مطالعه حاضر، ابتدا به ساخت شاخص شرایط مالی در الگوهای مختلف پارامترهای متغیر زمانی پرداخته و سپس عملکرد شاخص شرایط مالی در پیش‌بینی متغیرهای کلان اقتصادی با استفاده از رویکرد میانگین مربعات خطای پیش‌بینی (MSFE) و رویکرد مجموع تجمعی لگاریتم احتمالات پیش‌بینی مورد تجزیه و تحلیل قرار می‌گیرد. نتایج حاصله بیانگر آن است که شاخص شرایط مالی ساخته شده توانایی انطباق با حالت‌های مختلف اقتصاد ایران را دارد و نوسانات آن در طول زمان افزایش می‌یابد. براساس نتایج بدست آمده از رویکرد میانگین مربعات خطای پیش‌بینی، الگوی خودتوضیح برداری عامل افزوده شده با پارامترهای متغیر زمانی (TVP-FAVAR) در مقایسه با الگوی خودتوضیح برداری عامل افزوده شده (FAVAR) و نیز الگوی خودتوضیح برداری پارامتر متغیر زمانی عامل افزوده شده (FA-TVP-VAR) خطای پیش‌بینی کمتری را در برخی از متغیرهای کلان اقتصادی نشان می‌دهد و نیز استفاده از الگوهای ترکیبی خودتوضیح برداری عامل افزوده شده با پارامترهای متغیر زمانی که در آن ضرایب و مجموعه متغیرهای منتخب شاخص شرایط مالی بسته به شرایط اقتصادی تغییر می‌کنند، باعث بهبود عملکرد شاخص شرایط مالی در پیش‌بینی متغیرهای کلان اقتصادی می‌شود. نتایج مجموع تجمعی لگاریتم احتمالات پیش‌بینی نشان می‌دهد که به کارگیری الگوهای پارامتر متغیر اثر زیادی در کاهش خطای پیش‌بینی برخی از متغیرهای کلان ندارد.

کلمات کلیدی:

شاخص شرایط مالی، پیش‌بینی، متغیرهای کلان اقتصادی، میانگین مربعات خطای پیش‌بینی، مجموع تجمعی لگاریتم احتمالات پیش‌بینی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1852589>

