

عنوان مقاله:

کاربرد آزمون های ریشه واحد در داده های سری زمانی

محل انتشار:

دومین کنفرانس ملی رویکردهای نوین در علوم مدیریت ، اقتصاد و حسابداری (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 10

نویسندگان:

شیوا عطایی - دانشگاه شیراز، کارشناسی ارشد اقتصاد

ابراهیم هادیان - دانشگاه شیراز، دانشیار بخش اقتصاد

خلاصه مقاله:

بر اساس مباحث اقتصادسنجی جدید، وجود یا عدم وجود شکست های ساختاری، می تواند روابط میان متغیرهای کلان اقتصادی را تحت تأثیر قرار دهد؛ لذا عدم توجه به آن، ممکن است به نتایج غیرقابل اتکا و گمراه کننده ای منتهی شود. به گونه ای که وجود شکست ساختاری ممکن است موجب شود یک متغیر مانا، نامانا و دارای ریشه واحد نشان داده شود یا بالعکس. از این رو توجه به شکست های ساختاری در بررسی مانایی متغیرها ضروری به نظر می رسد. در این مقاله، چند نمونه از آزمون های ریشه واحدی که شکست ساختاری را در نظر نمی گیرند، با نمونه آزمون هایی که ریشه واحد متغیرها را در حالت وجود شکست (تغییر جهت) ساختاری مورد بررسی قرار می دهند، مطالعه شده است. تنها آزمون هایی در این مطالعه مورد بررسی قرار گرفته اند که برای تعیین ریشه واحد متغیرهای سری زمانی، کاربرد داشته باشند. لذا از داده های سری زمانیمربوط به متغیرهای نرخ ارز اسمی، حجم پول، شاخص قیمت مصرفکننده (به سال پایه 1383) و تولید ناخالص داخلی (به قیمت ثابت سال پایه 1383) برای بررسی و مقایسه آزمون های ریشه واحد استفاده شده است. لازم به ذکر است که داده های 1353) و کشور ایران می باشد.

کلمات کلیدی:

آزمون ریشه واحد، متغیرهای سری زمانی، شکست ساختاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/554924>

