

عنوان مقاله:

آزمون ناخطی معین برای قیمت های آتی نفت

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 4، شماره 10 (سال: 1381)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

حمید ابریشمی - دانشیار دانشکده اقتصادی دانشگاه تهران

علی معینی - استادیار دانشکده فنی دانشگاه تهران

مهدی احراری - کارشناس ارشد اقتصاد

خلاصه مقاله:

یکی از مسایل مهم و راهبردی در مباحث اقتصادی امروز دقت صحت و کارایی مدل های پیش بینی سری های زمانی است به همین دلیل در سال های اخیر توجه اقتصاد دانان به مدل های ناخطی معطوف شده است زیرا پدیده های متعددی نظیر آشوب در مدل های ناخطی قابل بررسی است در این مقاله به بررسی وجود آشوب در سری زمانی قیمت های آتی نفت 1999-96 می پردازیم به این منظور از دو روش عمومی و کاربردی تخمین بع هم بستگی cd و بزرگترین نمای لیاپانوف lle برای اثبات وجود آشوب و از تحلیل r/s یا نمای هرست he برای تشخیص غیر تصادفی بودن سری استفاده می کنیم به این ترتیب فرضیه غیر تصادفی و ناخطی بودن ساختار سری زمانی قیمت های آتی نفت را از منظر اثبات یا رد می کنیم به عبارتی دیگر می خواهیم به این پرسش پاسخ دهیم که آیا می توان یک مدل ناخطی پویا برای سری زمانی قیمت های آتی نفت پیشنهاد کرد تا به تبع آن بتوان یک پیش بینی تعیینی دقیق و صحیح را برآورد کرد بر اساس آزمون های انجام شده نشان می دهیم که سری زمانی قیمت های آتی نفت 1999-96 دارای ساختار آشوبناک ضعیف و معین است بنابراین می توان یک مدل ناخطی پویا را به منظور تعیین رفتار و پیش بینی تعیینی و با دقت بالا در کوتاه مدت برای سری زمانی قیمت های آتی نفت ارائه کرد

کلمات کلیدی:

آشوب معین، مدل سازی ناخطی، قیمت های آتی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/681922>

