

عنوان مقاله:

شناسایی چرخه های تجاری در اقتصاد ایران

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های اقتصادی ایران، دوره 5، شماره 15 (سال: 1382)

تعداد صفحات اصل مقاله: 28

نویسندگان:

ابراهیم هادیان - استادیار بخش اقتصاد دانشگاه شیراز

محمد رضا هاشم پور - کارشناس ارشد علوم اقتصادی

خلاصه مقاله:

هدف از این مقاله استخراج اجزای روند بلند مدت ادوار تجاری و تکانه های مامنظم از تولید ناخالص داخلی حقیقی ایران و همچنین شناسایی و تشخیص علل پیدایش ادوار تجاری در اقتصاد ایران است افزون بر این تولید ناخالص داخلی حقیقی ایران با توجه به سه جزء مذکور برای دوره 1379-1384 پیش بینی می شود روش کار شامل سه مرحله است اولین مرحله تشریح و تجزیه تولید ناخالص داخلی حقیقی ایران به اجزای مذکور دومین مرحله شامل ارایه بحثی درباره ارزیابی و تشخیص و همچنین بررسی علل پیدایش ادوار تجاری است و در نهایت سومین مرحله روش پیش بینی اجزای ذکر شده به منظور برآورد تولید ناخالص داخلی حقیقی ایران برای یک دوره پنج ساله است برای این منظور فرض می شود که داده های سالانه سری زمانی تولیدی ناخالص داخلی حقیقی ایران مجموع سه جزء روند بلند مدت نوسانات چرخه ای و حرکات نامنظم است برای تفکیک این اجزاء از فیلتر هادریک پرسکات در دو مرحله استفاده می شود در مرحله اول از این فیلتر جهت استخراج روند بلند مدت استفاده می شود در مرحله دوم جزء چرخه ای از باقیمانده حاصل استخراج می شود در ادامه برخی از متغیرهای کلان اقتصادی به منظور بررسی هم حرکتی و حساسیت مورد استفاده قرار می گیرد و نهایتاً برای پیش بینی اجزای مذکور از الگوهای ARIMA استفاده می شود

کلمات کلیدی:

چرخه های تجاری، اقتصاد ایران، فیلتر هادریک پرسکات

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/681944>

