

عنوان مقاله:

ارزیابی پیش بینی پذیری قیمت طلا و مقایسه پیش بینی روش های خطی و غیرخطی

محل انتشار:

فصلنامه نظریه های کاربردی اقتصاد، دوره 1، شماره 3 (سال: 1393)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

نویسندگان:

سیدعزیز آرمن - دانشیار گروه اقتصاد دانشگاه چمران اهواز

علی ریوفی - دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه چمران اهواز

خلاصه مقاله:

در این مقاله قابلیت پیش بینی بازده روزانه قیمت جهانی طلا از تاریخ 2011/07/25 تا 2012/12/17 مورد بررسی قرار گرفته است. بدین منظور ابتدا با استفاده از آزمون براک- دیکرت- شاینکمن (BDS) به بررسی خطی، غیرخطی و آشوبناک بودن سری مورد مطالعه پرداخته شده است. نتایج تحقیق فرض تصادفی بودن سری مورد مطالعه را رد می کند که شاهدهی بر پیش بینی پذیر بودن بازده روزانه قیمت طلاست. همچنین فرضیه عدم وجود رابطه غیرخطی در جملات پسماند مدل خطی رد می شود که نشان از وجود رفتار غیرخطی در سری مورد بررسی است. برای پیش بینی بازده روزانه قیمت طلا یک مدل عصبی فازی ANFIS طراحی گردیده و نتایج آن با استفاده از معیارهای مختلف مورد ارزیابی قرار گرفته است. همچنین نتایج با نتایج دو مدل خطی ARMA و غیرخطی GARCH مقایسه شد که مطابق انتظار، مدل غیرخطی ANFIS پیش بینی بهتری از سایر مدل های رقیب داشت. در نهایت با استفاده از آماره مورگان- گرنجر- نیبولد (MGN) معنی داری اختلاف پیش بینی مدل ها مورد بررسی قرار گرفت. نتایج حاکی از معنی دار بودن اختلاف پیش بینی مدل های غیرخطی نسبت به مدل خطی ARMA است.

کلمات کلیدی:

پیش بینی پذیری، شبکه عصبی فازی، ANFIS، آزمون BDS، روش های غیرخطی، قیمت طلا

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/703592>

