

## عنوان مقاله:

پیش بینی وقوع سیکل های تجاری در اقتصاد ایران با استفاده از فیلترهای میان گذر

## محل انتشار:

مجله سیاست گذاری اقتصادی، دوره 9، شماره 18 (سال: 1396)

تعداد صفحات اصل مقاله: 24

## نویسندگان:

پرویز رستم زاده - استادیار بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز

یزدان گودرزی فراهانی - دانشجوی دکتری اقتصاد، دانشگاه تهران

## خلاصه مقاله:

یکی از مهمترین مباحث اقتصادی، عوامل و زمان وقوع سیکل های تجاری می باشد لذا ضرورت دارد که این عوامل شناسایی شده و مورد بررسی قرار گیرند. هدف این مقاله بررسی و پیش بینی سیکل های تجاری در اقتصاد ایران در دوره زمانی ۱۳۷۰-۱۳۹۲ با استفاده از داده های فصلی می باشد. برای این منظور ابتدا متغیرهای تحقیق فصلی زدایی شده سپس با استفاده از فیلترهای میان گذر به استخراج سیکل های تجاری رخ داده در ایران پرداخته شده و به منظور پیش بینی وقوع سیکل های تجاری، از روش های رگرسیون لججیت و پروبیت استفاده گردیده است. متغیرهای مورد استفاده در این تحقیق شامل درآمدهای نفتی، مخارج دولت، نرخ تورم، تعداد پروانه های ساختمانی صادر شده و میزان واردات کالاهای واسطه ای و سرمایه ای می باشد. نتایج مدل برازش شده نشان دهنده این است که چنانچه درآمدهای نفتی، نرخ تورم و میزان واردات کالاهای سرمایه ای و واسطه ای افزایش یابد، احتمال وقوع رونق افزایش می یابد. افزایش تعداد جوازهای ساخت و ساز صادر شده احتمال وقوع رونق در اقتصاد را کاهش می دهد. پیش بینی درون نمونه ای نشان می دهد که مدل ها در ۹۵ درصد موارد مشاهدات را به درستی طبقه بندی نموده اند. در نتیجه قدرت پیش بینی درون نمونه ای همه مدل ها یکسان است. سپس با استفاده از این مدل به پیش بینی برون نمونه ای برای فاصله زمانی ۱۳۹۲-۱۳۹۴ پرداخته شده است. نتایج نشان دهنده توانایی بالای مدل در پیش بینی خارج از نمونه می باشد.

## کلمات کلیدی:

سیکل تجاری، رکود و رونق، فیلتر میان گذر، مدل لججیت و پروبیت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1935613>

