

## مدل سازی و پیش بینی رشد اقتصادی ایران با استفاده از مدل های ARIMA، مارکف سوئیچینگ و ANFIS

\*مرتضی صالحی سربیزان<sup>۱</sup>

۱. عضو هیئت علمی گروه صنایع دانشگاه زابل، ایران  
(دریافت: ۱۳۹۴/۷/۱۱ پذیرش: ۱۳۹۴/۸/۱۷)

## Modeling and Predicting of Iran's Economic Growth Using ANFIS, Markov Switching and ARIMA Models

\*Morteza Salehi Sarbijan<sup>1</sup>

1. Faculty Member of Industrial Engineering, Zabol University, Iran  
(Received: 3/Oct./2015 Accepted: 8/Nov./2015)

### Abstract:

Economic growth forecast is a major problem in economy that has a significant impact in government policy and economic planning. It also helps policy makers for future decisions. Multivariate econometric forecasting models associated with many limitations, so an alternative approach is the use of univariate models, but most of these methods need a lot of data to achieve the best result. In this study, data from 1959 to 2005 were used to estimate the models. Then the performances of auto regressive integrated moving average (ARIMA) model in the economic growth forecast of Iran was evaluated and compared with Markov switching method and fuzzy neural network (ANFIS) for the period from 2006 to 2013 using the Criteria RMSE, MAE and MAPE. Results showed that ANFIS model had the best performance. Furthermore, Markov switching method was more suitable than ARIMA model.

**Keywords:** Economic Growth, Markov Switching, ANFIS, ARIMA.

**JEL:** B41, C52, O5.

### چکیده:

یکی از مسائل مهم در اقتصاد پیش بینی رشد اقتصادی می باشد. پیش بینی صحیح رشد اقتصادی، اثر مهمی در سیاست گذاری و برنامه ریزی های اقتصادی دولت دارد و می تواند علاوه بر ایجاد زمینه توسعه روش های جدید پیش بینی، سیاست گذاران را در تصمیم گیری آتی یاری رساند. پیش بینی بر اساس مدل های چند متغیری اقتصادسنجی با محدودیت های زیادی همراه است، بنابراین یک روش جایگزین استفاده از مدل های تک متغیری است. اما اکثر روش های تک متغیری برای حصول به نتیجه خوب نیاز به داده های زیادی دارند. از این رو در این مطالعه کارایی مدل میانگین متحرک خودرگرسیون تجمعی (ARIMA) با روش های مارکف سوئیچینگ و شبکه عصبی فازی (ANFIS) در پیش بینی رشد اقتصادی ایران مقایسه می شود. برای تخمین مدل از داده های دوره ۱۳۳۸ تا ۱۳۸۴ استفاده شده است. سپس کارایی این مدل ها در پیش بینی رشد اقتصادی ایران برای دوره ۱۳۸۵ تا ۱۳۹۲ با استفاده از معیارهای RMSE، MAE و MAPE و ارزیابی و مقایسه شده است. مقایسه این معیارها حاکی از این است که بهترین عملکرد متعلق به روش ANFIS است. همچنین مدل مارکف سوئیچینگ عملکرد بهتری نسبت به مدل ARIMA دارد.

**واژه های کلیدی:** رشد اقتصادی، مارکف سوئیچینگ، ARIMA، ANFIS

**طبقه بندی JEL:** B41، C52، O5.

## ۱- مقدمه

در شرایط موجود اقتصاد کشور، توافق همگان، به ویژه اقتصاددانان، کارشناسان و سیاست‌گذاران کشور بر روی این مسئله اساسی اقتصادی کشور است که رشد اقتصادی و تولید در کشور، متناسب با ظرفیت منابع انسانی و طبیعی اقتصاد کلی نیست و به صورت کارا از توان، ظرفیت و پتانسیل‌های اقتصادی کشور بهره‌برداری نمی‌گردد، لذا نرخ بیکاری بالا منابع از جمله نیروی کار در کشور وجود دارد. از طرفی چون رشد اقتصاد ملی بیشتر بر نفت تکیه دارد، لذا دارای نوسان‌های زیادی می‌باشد و این نوسان و ناپایداری در برنامه‌ها و متغیرهای کلان اقتصادی مشاهده می‌شود. عوامل مذکور در کنار دلایل دیگر باعث پایین آمدن بهره‌وری در اقتصاد ملی گردیده و همین مسئله نیاز اساسی در زمینه تغییر ساختارها در جهت استفاده صحیح از منابع و پتانسیل‌های اقتصاد کشور را ایجاد نموده است لذا با توجه به موارد فوق‌الذکر بررسی روند حرکت متغیرهای اقتصادی و از آن جمله تولید ناخالص داخلی کشور که به معنی قدرت اقتصادی ملی همیشه مطرح بوده، از اهمیت ویژه‌ای برخوردار است. تغییرات تولید ناخالص داخلی به عنوان رشد اقتصادی قلمداد می‌گردد و به نوعی بیانگر روند تحولات اقتصادی و نشانگر بزرگ شدن اندازه اقتصاد ملی طی این دوره می‌باشد. تولید ناخالص داخلی به معنی مجموع تولید کالاها و خدمات نهایی مبادله شده در یک سال است و عبارت ناخالص زمانی که اقلامی مانند استهلاک از حساب‌ها کسر گردد به خالص تبدیل می‌شود. بنابراین از تولید ناخالص داخلی می‌توان برای مقایسه جایگاه یک کشور از لحاظ اقتصادی در میان سایر کشورها استفاده کرد و حتی این متغیر یکی از معیارهایی است که رشد اقتصادی یک کشور را نشان می‌دهد. رشد اقتصادی هر کشور، بیانگر رشد مداوم تولید است، که در اغلب موارد، با افزایش جمعیت و معمولاً با تغییرات زیربنایی همراه است (قره‌باغیان، ۱۳۷۲: ۱۱). امروزه رشد اقتصادی به دلایل زیر مطلوب جوامع است: ۱) بهبود آشکاری در وضعیت معاش، آسایش و مصرف شمار زیادی از مردم پدید آورده؛ به نحوی که اکنون در مقایسه با گذشته، مردم از تغذیه، وسائل زندگی، پوشاک، وسائل آموزشی و کالاهای مادی بیشتری برخوردارند؛ ۲) رشد، باعث افزایش محدوده انتخاب انسان به پذیرش ارزش‌ها می‌شود؛ ۳) پیشرفت فناوری سبب می‌شود میلیون‌ها نفر از انجام کارهای طاقت فرسای جسمی بی‌نیاز و در وقت انسان‌ها صرفه‌جویی شده و طبیعت در تسلط نسبی

بشر قرار گیرد؛ ۴) رشد موجب شکوفایی استعدادها و به کارگیری قوه ابتکار و خلاقیت در زمینه علوم مختلف از جمله در سازماندهی روابط اجتماعی، سیاسی و اقتصادی و تشکیل نهادهای مربوطه شده و سبب حاکمیت قانون، همراه با مشارکت عمومی در صحنه‌های سیاسی گردد؛ ۵) وابستگی متقابل مثبت و فزاینده جهانی؛ به نحوی که جهان به منزله دهکده کوچکی شده که هرچه در یک نقطه کوچک و دور افتاده اتفاق بیفتد، تمام دنیا از آن مطلع می‌شوند، از رشد اقتصادی بلندمدت ناشی می‌شود و ۶) قدرت سیاسی و نظامی کشور در داخل و در عرصه بین‌الملل افزایش می‌یابد (جهانبان، ۱۳۸۸: ۲۶).

پیش‌بینی بر اساس مدل‌های چند متغیره اقتصادسنجی با محدودیت‌های زیادی همراه است، برای مثال ممکن است اطلاعات در خصوص متغیرهای توضیحی که بر متغیر وابسته اثر می‌گذارند، وجود نداشته و همچنین برای پیش‌بینی متغیرهای وابسته ابتدا باید متغیرهای توضیحی پیش‌بینی شوند که در برخی موارد پیش‌بینی متغیرهای توضیحی امری دشوارتر از پیش‌بینی متغیر وابسته است. از این رو یک روش جایگزین استفاده از مدل‌های تک متغیر است که با استفاده از حافظه تاریخی متغیر اقدام به مدل‌سازی و پیش‌بینی می‌کند. اکثر این روش‌ها برای پیش‌بینی نیاز به داده‌های زیادی دارند، اما دسترسی به داده‌های زیاد از نظر کمی و کیفی نیاز به زمان و هزینه زیادی دارد. از این رو روش‌هایی که بتوانند با داده‌های کم پیش‌بینی مناسبی انجام دهند بسیار مورد توجه است. روش‌های پیش‌بینی فازی، به دلیل استفاده از اعداد فازی به جای اعداد قطعی، در مقایسه با دیگر روش‌های پیش‌بینی به داده‌های کمتری نیاز دارند. از آنجا که یکی از مشکلات محققان در ایران عدم دسترسی به آمارهای کافی مخصوصاً آمارهای متغیرهای کلان اقتصادی است، در این مطالعه به معرفی مدل‌های ARIMA، مارکف سوئیچینگ و ANFIS جهت پیش‌بینی رشد اقتصادی ایران پرداخته و عملکرد این مدل‌ها در پیش‌بینی ایستای رشد اقتصادی ایران مقایسه می‌شود. در بخش دوم به ادبیات موضوع تحقیق و در بخش سوم به متدولوژی اقتصادسنجی پرداخته می‌شود. سپس در بخش چهارم نتایج تحقیق و در بخش پنجم بحث و نتیجه‌گیری مطرح شده و در بخش پایانی پیشنهادات مقاله ارائه می‌شود.

## ۲- پیشینه تحقیق

در ادبیات اقتصادی، بررسی علل رشد اقتصادی از جایگاه ویژه‌ای برخوردار بوده و توجه اقتصاددانان بسیاری را به خود جلب نموده و در این باره حجم گسترده‌ای از مطالعات را به خود اختصاص داده است. مطالعات اولیه عمدتاً بر نقش سرمایه فیزیکی به عنوان عامل رشد تأکید داشته است و مطالعات اخیر با گسترش مفهوم سرمایه از حیثه محدود به "ماشین آلات و تجهیزات" به محدوده وسیع‌تر دانش متبلور شده در انسان و تحقیقات از یک سو و نهادهای اجتماعی از سوی دیگر را نیز شامل می‌شود، تلاش نموده‌اند نواقص تحلیل‌های کلاسیک رشد اقتصادی را برطرف نمایند.

برخی از اقتصاددانان همانند استوارت میل، لوئیس، واگنر، برو و نورث هر کدام به نوعی، عوامل نهادی و سرمایه‌های اجتماعی را برای تبیین رشد کشورها پیشنهاد می‌کنند. در این باره کشوری که سرمایه‌گذاری را برای فعالیت، انتقال فناوری از خارج و تخصص و مهارت افراد جذب می‌کند، باید نهادها و قوانین آن به تولید گرایش داشته و اقتصاد آن برای تجارت بین‌المللی و رقابت در سطوح بازارهای جهانی باز باشد و نهایتاً نهادهای اقتصادی آن پایدار باشند. بنابراین، زیرساخت هر اقتصاد، حکومت و مقررات آن و نهادهایی که به آنها قدرت می‌بخشند، از جمله عوامل تعیین کننده رشد اقتصادی هر کشوری هستند (جونز<sup>۱</sup>، ۱۹۹۷: ۴۶).

مطالعات زیادی در زمینه رشد اقتصادی و پیش‌بینی با شبکه عصبی و مدل‌های خودرگرسیون صورت گرفته است که در زیر به ذکر چندین مورد پرداخته می‌شود.

گن و ونگ<sup>۲</sup> با استفاده از مدل BVAR<sup>۳</sup> به پیش‌بینی تولید ناخالص داخلی فصلی سنگاپور پرداخته‌اند. مدل‌سازی برای دوره ۱۹۷۶:۱-۱۹۸۸:۴ انجام شده است و برای دوره ۱۹۸۹:۱-۱۹۹۲:۴ پیش‌بینی شبیه‌سازی شده است. آنها با توجه به عملکرد مناسب مدل در پیش‌بینی، سادگی شناسایی، برآورد و به کارگیری مدل به این نتیجه رسیده‌اند که این مدل برای تکمیل مدل ساختاری اقتصادسنجی برای انجام قضاوت‌های اقتصادی مناسب است (گن و ونگ، ۱۹۹۳: ۱۶).

سوانسن و وایت<sup>۴</sup> به ارزیابی عملکرد شبکه‌های عصبی در مدل‌سازی و پیش‌بینی نه متغیر فصلی و ماهانه اقتصاد کلان آمریکا از جمله GNP و خالص صادرات کالاها و خدمات به

صورت فصلی می‌پردازند و بیان می‌کنند که نتایج مناسبی در مقایسه با حالات دیگر به دست آمده است. آنها همچنین می‌افزایند که معیار اطلاعات شوارتز (SIC) در داده‌های درون-نمونه، راهنمای مناسبی برای عملکرد خارج-نمونه نیست (سوانسن و وایت، ۱۹۹۷: ۵۴۹).

ابی‌سینگه<sup>۵</sup> یک متدولوژی برای فرمول‌بندی رگرسیون پویا با استفاده از متغیرهایی با دامنه زمانی مختلف ارائه کرد. در این مقاله پیش‌بینی GDP فصلی سنگاپور با استفاده از متغیر ماهانه تجارت خارجی انجام شده است. در مدل ارائه شده، با استفاده از ترکیبات غیرخطی نمایی از متغیر ماهانه تجارت خارجی چندین متغیر ساخته شده و با استفاده از آنها و تأخیر پیشین خود متغیر GDP، برآورد و پیش‌بینی انجام شده است (ابی‌سینگه، ۱۹۹۸: ۵۰۶). هوکینن و ویرن<sup>۶</sup> با استفاده از مدلی بر پایه نظریه کینز به نام مدل فصلی دپارتمان اقتصاد بانک فنلاند (QMED)<sup>۷</sup> به پیش‌بینی کوتاه‌مدت ۵۰ متغیر اقتصاد کلان به‌ویژه نرخ رشد فصلی GDP و نرخ بیکاری پرداخته‌اند. آنها با استفاده از شبیه‌سازی تصادفی و با به کارگیری متغیرهای درون‌زا و برون‌زا برای دوره ۱۹۹۶-۱۹۷۶ عملکرد پیش‌بینی برای ۲۴ دوره را بهبود بخشیده‌اند (هوکینن و ویرن، ۱۹۹۹: ۷۵۳).

استاک و واتسون<sup>۸</sup> در بررسی جامعی، نقش متغیرهای مالی و دیگر سری‌های زمانی اقتصاد کلان را در پیش‌بینی نرخ رشد GDP و تورم ۷ کشور OECD بررسی کردند. آنها با استفاده از داده‌ها به پیش‌بینی چهارگام برای دوره‌های ۱۹۷۱:۱-۱۹۸۴:۴ و ۱۹۸۵:۱-۱۹۹۹:۴ با استفاده از ۲۶ سری شاخص پرداختند (استاک و واتسون، ۲۰۰۳: ۷۸۸).

بافیگی و همکاران<sup>۹</sup> به پیش‌بینی نرخ رشد GDP آلمان، فرانسه، ایتالیا و ناحیه اروپا با استفاده از مدل بریج<sup>۱۰</sup> (BM) و مدل‌های پایه دیگری مثل ARIMA و VAR و یک مدل ساختاری پرداخته‌اند. آنها با استفاده از داده‌های ۱۹۸۰:۱-۱۹۹۰:۴ به پیش‌بینی یک و دو گام رو به جلو پرداخته‌اند و نتیجه گرفته‌اند که به شرطی که در محدوده افق پیش‌بینی چند شاخص موجود باشد، BM بهتر عمل می‌کند. آنها همچنین نتیجه گرفته‌اند بهتر است برای تک تک کشورهای نرخ رشد

5. Abeyasinghe (1998)

6. Hukkinen &amp; Viren (1999)

7. Quarterly Model of the Economics Department of the Bank of Finland

8. Stock &amp; Watson (2003)

9. Baffigi et al. (2004)

10. Bridge Model

1. Jones (1997)

2. Gan &amp; Wong (1993)

3. Bayesian Vector Autoregressive

4. Swanson &amp; White (1997)

مدل ARIMA با هدف پیش بینی صادرات تایوان انجام داد. مدل بررسی شده، روش سری زمانی شامل مدل های اکتشافی و مدل مارکف است. در این پژوهش برای تحقیق بیشتر در مورد اینکه آیا پیش بینی مدل به طول دوره مورد بررسی وابسته است، دوره مورد مطالعه به سه دوره زمانی تقسیم شده است. نتایج حاصل از پیش بینی توسط مدل های فوق برای سه دوره زمانی حاکی از آن است که برای دوره زمانی طولانی مدل ARIMA خطای پیش بینی کمتری دارد اما وقتی که دوره زمانی کوتاه تر می شود عملکرد سری زمانی فازی بهتر می شود. همچنین مدل اکتشافی نسبت به مدل مارکف خطای پیش بینی کمتری دارد. وانگ در پایان بیان می کند که با توجه به عملکرد مدل اکتشافی در بهبود نتایج پیش بینی و روش محاسبه ساده آن، زمانی که با کمبود مشاهدات مواجه هستیم یا بخواهیم پیش بینی دقیق تری انجام دهیم مدل سری زمانی فازی بسیار مفید است (وانگ، ۲۰۱۱: ۹۲۹۷).

کین و همکاران<sup>۶</sup> به مقایسه عملکرد پیش بینی خارج از نمونه روش نشانگرهای اتوماتیک مقدم<sup>۷</sup> (ALIs) با مدل های ساختاری اقتصاد کلان<sup>۸</sup> (MESMs) برای پیش بینی رشد تولید ناخالص داخلی فصلی و تورم سه کشور چین، اندونزی و فیلیپین پرداخته اند. آنها به این نتیجه رسیدند که روش ALI به طور کلی در کوتاه مدت (یک فصل رو به جلو) بهتر عمل می کند ولی با افزایش افق پیش بینی عملکرد ضعیف تری نسبت به روش های ساختاری دارد (کین و همکاران، ۲۰۰۸: ۴۰۰).

برهومی و همکاران<sup>۹</sup> به مقایسه عملکرد مدل های عاملی مختلف برای پیش بینی GDP فصلی فرانسه پرداخته اند. مدل های یاد شده هم در دامنه زمان و هم در دامنه فرکانس بوده اند. آنها با استفاده از داده های اقتصادی ماهانه ۱۹۹۳-۲۰۰۷ و با استفاده از معیار RMSE به مقایسه مدل های مختلف برای سه پایگاه داده کوچک (۲۰ متغیر)، متوسط (۵۱ متغیر) و بزرگ (۱۴۰ متغیر) با دو شیوه پیش بینی بازگشتی و غلتان<sup>۱۰</sup> پرداخته اند و نتیجه گرفته اند که عمدتاً مدل های ساده تر بهتر جواب می دهند (برهومی و همکاران، ۲۰۱۰: ۱۴۳). پوزولس و همکاران<sup>۱۱</sup> با به کار گرفتن سیستم های استنتاج فازی و با استفاده از تخمین ناپارامتری واریانس باقی مانده ها، یک مدل تواری اتوماتیک برای پیش بینی کوتاه و بلندمدت

پیش بینی شود تا اینکه برای کل اتحادیه اروپا یک بار پیش بینی انجام شود (بافیگی و همکاران، ۲۰۰۴: ۴۴۸). شوماخر<sup>۱</sup> عملکرد پیش بینی GDP آلمان را با استفاده از داده های پانلی فصلی اقتصادی (۱۲۴ سری فصلی در دوره ۱۹۷۸:۱-۲۰۰۴) با معیار MSE مورد بررسی قرار داده است. او با استفاده از تحلیل مؤلفه اصلی (PCA) استاتیک، تحلیل مؤلفه اصلی پویا در دامنه فرکانس و یک مدل دیگر و مدل الگوی اتورگرسیو نهایتاً نتیجه گرفت که به طور متوسط پیش بینی خارج نمونه یک گام و چهار گام سه مدل عاملی از مدل الگوی اتورگرسیو بهتر بوده است (شوماخر، ۲۰۰۷: ۲۷۱). بعداً شوماخر این کار را با استفاده از داده های ماهانه و فصلی و مدل عاملی با روشی مرکب از الگوریتم EM و برآوردگر مؤلفه اصلی بهبود بخشید (شوماخر، ۲۰۰۸: ۳۸۷). همچنین شوماخر به بررسی اثر داده های بین المللی برای پیش بینی GDP آلمان پرداخت و توانست به دقت بهتری برسد (شوماخر، ۲۰۱۰: ۹۶). بانورا و رونسترلر<sup>۲</sup> با استفاده از شاخص های ماهانه در DFM به پیش بینی GDP فصلی ناحیه اروپا پرداخته اند (بانورا و رونسترلر، ۲۰۱۱: ۳۳۴).

ژانگ و کی<sup>۳</sup> با استفاده از شبکه های عصبی و ARIMA به پیش بینی ۱۰ سری زمانی ماهانه اقتصادی آمریکا پرداخته اند. آنها در این مقاله با حذف روند و اثر فصلی موجود در داده ها به نتایج مناسبی رسیدند و نتیجه گرفتند که پیش پردازش داده ها نقش بسیار مؤثری در عملکرد پیش بینی دارد به طوری که نتایج اجرای شبکه عصبی بدون پیش پردازش داده ها از نتایج روش ARIMA بدتر بوده است. آنها به منظور مقایسه نتایج، از معیارهای RMSE و MAE و MAPE استفاده کردند (ژانگ و کی، ۲۰۰۵: ۵۰۲).

همزاسی<sup>۴</sup> به منظور پیش بینی سری های فصلی با استفاده از شبکه های عصبی با در نظر گرفتن ترم های فصلی توانسته اند مدلی جدید به نام SANN ارائه دهند که عملکرد مدل در پیش بینی چهار سری از جمله سری الگوی مسافران هوایی بین المللی و ارزش کل تولید صنعت ماشین آلات تایوان با معیارهایی چون MSE و MAE و MAPE بهتر از دیگر مدل ها بوده است (همزاسی، ۲۰۰۸: ۴۵۵۱).

وانگ<sup>۵</sup> نیز مطالعه مقایسه ای بین مدل سری زمانی فازی و

6. Qin et al. (2008)  
6. Automatic Leading Indicators  
8. Macroeconomic Structural Models  
9. Barhoumi et al. (2010)  
10. Rolling  
11. Pouzols et al (2008)

1. Schumacher (2007)  
2. Banbura & Runstler (2011)  
3. Zhang & Qi (2005)  
4. Hamzacebi (2008)  
5. Wang (2011)

قالب مدل‌های ARIMA، مارکف سوئیچینگ و ANFIS پرداخته می‌شود.

### ۳- روش تحقیق

#### ۳-۱- مدل سری زمانی ARIMA

یک سری زمانی ایستا<sup>۴</sup> را می‌توان به روش‌های گوناگونی مدل‌سازی نمود. یکی از متداول‌ترین مدل‌سازی‌ها در اقتصادسنجی بر پایه متدولوژی باکس و جنکینز<sup>۵</sup> و تکیه بر مقادیر گذشته سری زمانی و جملات خطای استوکاستیک می‌باشد. این نوع مدل‌سازی که به مدل‌سازی ARIMA مشهور است، به طور گسترده توسط محققین مورد استفاده قرار گرفته است و حالت کلی آن برای  $ARIMA(p,d,q)$  به صورت رابطه (۱) است (کانگ<sup>۶</sup>، ۱۹۸۰: ۶۶). (متغیر  $y_t$  ایستا در سطح فرض شده است).

$$y_t = \alpha_0 + \sum_{i=1}^p \alpha_i y_{t-i} + \sum_{j=1}^q \beta_j \varepsilon_{t-j} \quad (1)$$

با وجود کاربرد فراوان رابطه (۱) در مدل‌سازی سری‌های زمانی، چنان‌چه مشاهده می‌شود پارامترهای این مدل در طول زمان ثابت فرض می‌شود. به عبارت دیگر، این رابطه در طول زمان به صورت خطی تعدیل می‌شود. اما اکثر متغیرهای اقتصادی در طول زمان به صورت خطی تعدیل نمی‌شوند. به عنوان مثال در مباحث چرخه‌های تجاری مشاهدات تجربی نشان می‌دهد سرعت تغییرات متغیرهای کلان اقتصادی در دوران رکود سریع‌تر از دوران رونق اقتصادی است. لذا مدل‌های ARIMA برای مدل‌سازی اینگونه متغیرها چندان مناسب نخواهد بود چرا که این مدل‌ها برای مدل‌سازی تعدیلات خطی به کار می‌روند و در تغییرات متغیرها در طی زمان تفاوتی قائل نمی‌شوند. البته لازم به ذکر است در برخی مباحث که فرض خطی بودن تعدیل متغیر خدشه اساسی به مطالعه وارد نمی‌کند، استفاده از مدل‌سازی ARIMA برای ساده‌سازی مدل بسیار مناسب است. با توجه به مطالب مذکور برای مطالعه فرایندهای تعدیل خطی و مدل‌سازی سری‌های زمانی که رفتار غیرخطی دارند، نیازمند توسعه مدل‌های ARIMA خواهیم بود. روش‌های خطی که در یک سطح وسیع برای مدل‌سازی متغیرهای اقتصادی مورد استفاده قرار می‌گیرند، با توجه به رفتار نامتقارن اکثر این متغیرها، در دستیابی به تغییرات

سری‌های زمانی ارائه کرده‌اند و آن را بر روی شش سری زمانی الگو از جمله اعداد لکه خورشیدی تست کرده‌اند و عملکرد روش آنها در مقایسه با روش‌های LS-SVM<sup>۱</sup>، OP-ELM<sup>۲</sup> و k-NN بر پایه آتورگرس کننده‌ها بهتر بوده است (پوزولس و همکاران، ۲۰۰۸: ۲۱۶۶).

جیوانیس<sup>۳</sup> با استفاده از تکنیک ANFIS چهار متغیر مهم اقتصاد کلان آمریکا که عبارتند از GDP، نرخ تورم، نرخ بهره اوراق قرضه شش ماهه و نرخ بیکاری، را پیش‌بینی کرده است. در این پژوهش از داده‌های فصلی GDP برای دوره ۲۰۰۹-۱۹۹۱ و از داده‌های ماهانه برای دیگر متغیرها برای دوره ۲۰۰۹-۱۹۵۰ استفاده شده است. او عملکرد این روش را با روش‌هایی که بیشتر به کار رفته است مقایسه کرده است. او ANFIS را با روش‌های مختلف خطی ARIMA و غیرخطی STAR مقایسه کرده و نتیجه گرفته است که در همه موارد عملکرد خارج از نمونه این روش از منظر RMSE و MAE نتایج بهتری داشته است. برای ANFIS تنها از یک تابع عضویت مثلثی استفاده کرده است. مضاف بر این، در پیش‌بینی متغیر GDP روش‌های مختلف ARIMA عملکرد بهتری از روش‌های STAR داشته‌اند (جیوانیس، ۲۰۱۰: ۶۶۰).

میرباقری به پیش‌بینی رشد اقتصادی ایران از دو روش شبکه عصبی فازی و منطق فازی برای دوره زمانی ۲۰۰۶-۲۰۰۲ پرداخت و از متغیرهای مخارج دولت به تولید ناخالص داخلی، رشد صادرات، نسبت تورم برای پیش‌بینی استفاده کرد و این مدل را بهترین مدل برای پیش‌بینی رشد معرفی کرد. نتایج نشان داد که شبکه عصبی فازی بهتر از منطق فازی به پیش‌بینی تورم ایران می‌پردازد (میرباقری، ۲۰۱۰: ۹۲۶).

جعفری صمیمی و همکاران در تحقیق خود مقایسه‌ای بین سه روش سری‌های زمانی، شبکه‌های عصبی و هموارسازی نمایی برای پیش‌بینی رشد اقتصادی ایران انجام دادند. آنها از داده‌های فصلی ۲۰۰۳-۱۹۹۸ استفاده کردند و نتایج پیش‌بینی‌های هر روش را محاسبه و با مقادیر واقعی بر اساس معیار خطای اندازه‌گیری مقایسه کردند. نتایج حاکی از عملکرد بهتر شبکه عصبی نسبت به دو روش دیگر در پیش‌بینی رشد اقتصادی ایران است (جعفری صمیمی و همکاران، ۲۰۰۷: ۲۰ و جعفری صمیمی و همکاران، ۱۳۹۳: ۲۵).

در این مطالعه به مدل‌سازی و پیش‌بینی رشد اقتصادی ایران در

4. Stationary  
5. Box-Jenkins Methodology  
6. Kang (1980)

1. Least-Squares Support Vector Machine  
2. Optimally Pruned Extreme Learning Machine  
3. Giovanis (2010)

با فرض اینکه متغیر  $y_t$ ، فرآیند اتورگرسیو مرتبه  $P$  و  $m$  با رژیم، مدل سازی شود  $(MS(m) - AR(p))$  رابطه (۴) را خواهیم داشت.

$$y_t = \sum_{i=1}^m \left( \sum_{j=1}^p (\beta_{ij} y_{t-j}) + u_{it} \right) I_i(S_t = i) \quad (4)$$

$$I_i(S_t = i) = \begin{cases} S_t = i \rightarrow 1 \\ S_t \neq i \rightarrow 0 \end{cases}$$

در رابطه (۴) احتمال انتقال وضعیت از یک رژیم به رژیم دیگر در قالب احتمالات شرطی قابل محاسبه خواهد بود. به عنوان مثال در مدل فوق،  $P_{ij}$  که نشانگر انتقال از رژیم  $i$  به رژیم  $j$  است به صورت رابطه (۵) تعریف می شود.

$$P_{ij} = P(S_{t+1} = j | S_t = i); \sum_{j=1}^m P_{ij} = 1, \forall i, j \in (1, 2, \dots, m) \quad (5)$$

همچنین  $u_t \approx N(0, \sigma^2)$  می باشد و  $S_t$  نتیجه یک زنجیره مارکوف با  $N$  رژیم است و  $S_t$  برای همه  $t$ ها مستقل از  $u_t$  است. به طوری که  $P_{12}$  احتمال انتقال از رکود به رونق و  $P_{21}$  احتمال از رژیم رونق به رکود خواهد بود و  $P_{11}$  احتمال پایداری رژیم رکود و  $P_{22}$  احتمال پایداری رژیم رونق را نشان خواهد داد. مدل های مارکوف سوئیچینگ برای پیش بینی رشد تولید ناخالص داخلی ایران بسته به اینکه کدام قسمت مدل اتورگرسیو وابسته به رژیم باشد و تحت تأثیر آن انتقال یابد به انواع مختلف طبقه بندی می شود. آنچه در مطالعات اقتصادی بیشتر مورد توجه است شامل چهار حالت مدل های مارکوف سوئیچینگ در میانگین (MSM)، عرض از مبدأ (MSI)، پارامترهای اتورگرسیو (MSA) و ناهمسانی در واریانس (MSH) می باشد. با توجه به این واقعیت که بر اساس نظریه های اقتصادی و مشاهدات تجربی برخی از متغیرهای اقتصادی دارای رفتار غیرخطی هستند، با استفاده از مدل های یاد شده می توان این گونه متغیرها را به صورت غیرخطی مدل سازی کرد. در حالت کلی می توان انواع مختلف مدل های اتورگرسیو مارکوف سوئیچینگ را با استفاده از مدل اتورگرسیو خطی تبیین نمود. با فرض یک مدل اتورگرسیو مرتبه  $p$  مطابق رابطه (۶) داریم.

$$\Delta y_t = V + \sum_{i=1}^p A_i \Delta y_{t-i} + u_t \quad (6)$$

$$\begin{cases} V = V(S_t) \rightarrow MSI \\ A_i = A_i(S_t) \rightarrow MSA \\ VAR(u) = (VAR(u))(S_t) \rightarrow MSH \end{cases}$$

نامتقارن این متغیرها عاجزند و این مسئله باعث افزایش رغبت محققان برای استفاده از مدل های غیرخطی که نسبت به مدل های خطی انعطاف بیشتری دارند، شده است. در میان مدل های غیرخطی، مدل اتورگرسیو تعمیم یافته<sup>۱</sup>، مدل دوگانه<sup>۲</sup>، مدل اتورگرسیو آستانه ای<sup>۳</sup>، مدل های با انتقال ملایم<sup>۴</sup>، شبکه های عصبی<sup>۵</sup> و مدل مارکوف سوئیچینگ اتورگرسیو را می توان نام برد.

### ۳-۲- مدل مارکوف سوئیچینگ

در مدل های غیرخطی فرض بر این است که رفتار متغیری که مدل سازی روی آن انجام می گیرد در وضعیت های مختلف متفاوت بوده و تغییر می کند (مهدیلو و همکاران، ۱۳۹۴: ۱۳). مدل های غیر خطی از لحاظ سرعت تغییر از یک وضعیت به وضعیت دیگر به دو گروه عمده تقسیم می شوند. در برخی از این مدل های غیر خطی، تغییر از یک وضعیت به وضعیت دیگر به صورت ملایم و آهسته<sup>۶</sup> انجام می گیرد (مانند مدل های STAR<sup>۷</sup> و شبکه مصنوعی<sup>۸</sup>) در برخی دیگر از این مدل های غیر خطی این انتقال به سرعت انجام می گیرد که مدل مارکوف سوئیچینگ از این نوع مدل ها می باشد. در مدل های STAR و شبکه مصنوعی فرایند تبدیل رژیم تدریجی است؛ فرایند تعدیل در این مدل ها بستگی به وضعیت سیستم دارد. برخلاف این مدل ها، در مدل انتقال مارکوف، تبدیل رژیم به صورت برونزا در نظر گرفته شده است. مدل های مارکوف سوئیچینگ توسط همیلتون<sup>۹</sup> در سال ۱۹۸۹ برای استخراج چرخه های تجاری توسعه داده شده اند (همیلتون، ۱۹۸۹: ۳۶۰). برای درک بهتر مدل مارکوف سوئیچینگ، متغیر ایستای  $y_t$  را فرض نمایید که برای رژیم اول  $S_t = 1$  توسط فرآیند اتورگرسیو رابطه (۲) توصیف می شود. حال فرض کنید متغیر  $y_t$  برای رژیم دوم  $S_t = 2$  توسط مدل اتورگرسیو متفاوت رابطه (۳) تبیین شود.

$$y_t = \alpha_1 + \beta_1 y_{t-1} + \varepsilon_{1t} \quad (2)$$

$$\varepsilon_{1t} \rightarrow N(0, \sigma_1^2)$$

$$y_t = \alpha_2 + \beta_2 y_{t-1} + \varepsilon_{2t} \quad (3)$$

$$\varepsilon_{2t} \rightarrow N(0, \sigma_2^2)$$

1. Generalized Autoregressive Model
2. Bilinear Model
3. Threshold Autoregressive Model
4. Smooth Transition
5. Artificial Neural Network
6. Smooth Transition
7. Smooth Transition Autoregressive
8. Artificial Neural Network
9. Hamilton (1989)

(جانگ، ۱۹۹۷: ۵۵).

$$O_i^2 = \omega_i = \mu_{\bar{A}_{1,i}}(x_1)\mu_{\bar{A}_{2,i}}(x_2), \quad i = 1, 2$$

اگر  $x_1$  متعلق به  $\bar{A}_{1,1}$ ،  $x_2$  متعلق به  $\bar{A}_{1,2}$ ، آنگاه  $\bar{A}_{2,1}$  متعلق به  $x_1$  اگر  $Z_1 = p_1x_1 + q_1x_2 + r_1$ ،  $x_2$  متعلق به  $\bar{A}_{2,2}$ ، آنگاه  $Z_2 = p_2x_1 + q_2x_2 + r_2$  ساختار ANFIS معادل در نمودار (۱) با فرض یکسان بودن

$$\Delta y_t = \mu(S_t) + \sum_{i=1}^p A_i (\Delta y_t - \mu(S_t)) + u_t \rightarrow MSM \quad (7)$$

توابع برای همه گره‌ها آمده است. برای لایه‌های دوم تا چهارم،  $O_i^k$  نشان دهنده خروجی قاعده  $\mu$  در لایه  $k$ ام است. لایه ۱: خروجی هر گره در این لایه درجه عضویتی از یک مجموعه فازی متناظر با هر ورودی است. تابع عضویت این مجموعه فازی می‌تواند هر تابع عضویت پارامتری مناسب مثل تابع گاوسی باشد. پارامترهای توابع عضویت همان پارامترهای مقدم سیستم استنتاج هستند.

$$O_{j,i}^1 = \mu_{\bar{A}_{j,i}}(x_j), \quad i, j = 1, 2$$

توجه کنید که  $O_{j,i}^1$  خروجی  $\mu$  ورودی در قاعده  $\mu$ ام در لایه اول می‌باشد.

لایه ۲: خروجی هر گره در این لایه قدرت آتش قاعده را نشان می‌دهد. برای محاسبه خروجی می‌توان از حاصل ضرب یا کمینه مقدار تمامی سیگنال‌های ورودی یا هر  $T$  نرم دیگری (برای عملگر AND) استفاده کرد.

لایه ۳: خروجی هر گره در این لایه، مقدار نرمال شده خروجی لایه دوم می‌باشد.

$$O_i^3 = \bar{w}_i = \frac{w_i}{w_1 + w_2}, \quad i = 1, 2$$

لایه ۴: خروجی هر گره در این لایه مقادیر نرمال شده هر قاعده فازی است. ضرایب معادله خطی چندجمله‌ای هر قاعده همان پارامترهای پیامد در سیستم استنتاج هستند.

لایه ۵: خروجی این گره، خروجی نهایی سیستم است که مجموع تمامی سیگنال‌های ورودی می‌باشد.

$$y = \sum_{i=1}^2 \bar{w}_i z_i = \frac{\sum_{i=1}^2 \bar{w}_i z_i}{\sum_{i=1}^2 \bar{w}_i}$$

برای اینکه در یک مدل عصبی-فازی غیرخطی، پارامترها را تعیین کنیم، ترکیب روش کاهش شیب با پس انتشار خطا

که در مدل رابطه (۶)  $\Delta y_t$  نماینده متغیر رشد تولید و همچنین  $V(S_t)$  به عنوان میانگین فرآیند یا عرض از مبدأ در رژیم‌های مختلف می‌باشد. همچنین  $A_i$  و  $B_i$  به ترتیب ضرایب متغیرهای AR و MA هستند.  $\epsilon_t$  سری باقیمانده‌ها می‌باشد. حال اگر رابطه (۶) را به صورت رابطه (۷) بازنویسی کنیم. مدل MSM قابل تبیین است. خلاصه مدل‌های MS-AR در جدول (۱) ارائه شده است (کروزلزیک<sup>۱</sup>، ۱۹۹۷: ۱۱).

با توجه به این واقعیت که برخی از متغیرهای اقتصادی بر اساس نظریه‌های اقتصادی و مشاهدات تجربی دارای رفتار غیر خطی هستند، لذا می‌توان این گونه متغیرها را با استفاده از مدل‌های مندرج در جدول (۱) مدل‌سازی نمود. در نهایت باید متذکر شد که تخمین مدل مارکف سوئیچینگ از روش‌هایی نظیر تخمین حداکثر درست‌نمایی<sup>۲</sup>، ماکزیمم حداکثر انتظار<sup>۳</sup> و روش نمونه برداری گیبس<sup>۴</sup> انجام می‌گیرد. برای آنکه بتوان بهترین مدل را از میان مدل‌های فوق انتخاب نمود در این مطالعه استرژژی انتخاب مدل به صورت زیر خواهد بود.

- تعیین تعداد وقفه‌های بهینه برای متغیرهای حاضر در مدل با استفاده از آماره اطلاعاتی آکاییک برای تمام حالت‌های ممکن مدل مارکف سوئیچینگ

- مقایسه حالت‌های تخمین زده شده بر مبنای سه ویژگی:
  - داشتن بیشترین ضرایب معنادار (به ویژه اجزای وابسته به رژیم)

- داشتن بیشترین مقدار تابع حداکثر راستنمایی

- داشتن حداقل واریانس جملات اخلاص

### ۳-۳- شبکه عصبی - فازی (ANFIS)

عبارت ANFIS که مخفف سیستم استنتاج عصبی-فازی تطبیقی است، یک پارادایم عصبی-فازی کارا و شفاف است که برای اولین بار توسط جانگ<sup>۵</sup> و همکاران در سال ۱۹۹۷ ارائه شد. استنتاج فازی سوگنو انتخاب مناسبی است که نیاز به عملیات غیرفازی سازی ندارد و در مدل‌سازی‌های فازی نمونه‌گرا<sup>۶</sup> به وفور مورد استفاده قرار گرفته است. یک سیستم استنتاج فازی با دو ورودی  $x_1$  و  $x_2$  و یک خروجی  $y$  را در نظر بگیرید. برای یک مدل سوگنوی مرتبه اول، مجموعه‌ای از دو قاعده فازی اگر آنگاه را به صورت زیر در نظر بگیرید

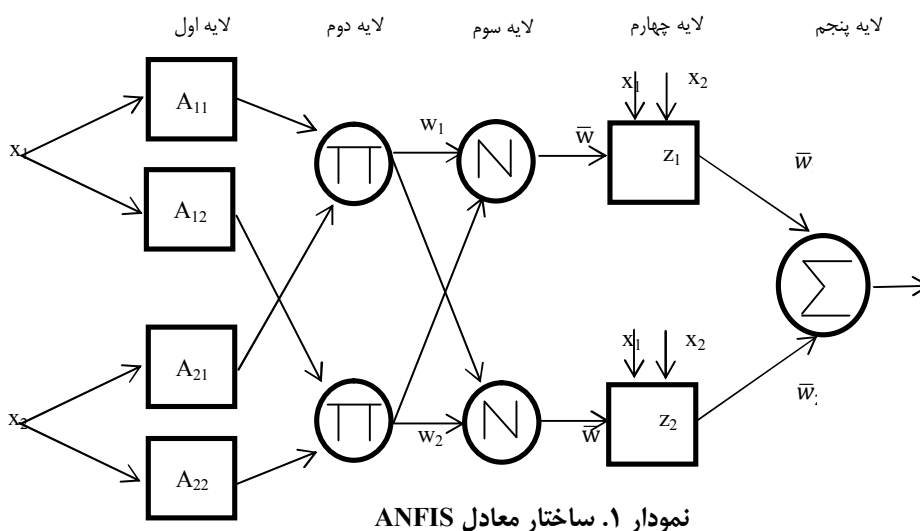
1. Krolzig (1997)
2. Maximum Likelihood Estimation (MLE)
3. Expectation Maximization (EM)
4. Gibbs Sampling Approach
5. Jang et al. (1997)
6. Sample-Based

می تواند برای آموزش شبکه عصبی به کار گرفته شود. با این وجود معمولاً این روش بهینه سازی برای همگرایی به زمان زیادی نیاز دارد.

جدول ۱. خلاصه مدل های MS-AR

توضیحات	MSM		MSI	
	میانگین متغیر	میانگین ثابت	عرض از مبدأ متغیر	عرض از مبدأ ثابت
ثابت $\sigma$	MSM	Mخطی	MSI	خطی
	MSMH	MSH	MSIH	MSH
متغیر $\sigma$	MSMA	MSA	MSIA	MSA
	MSMAH	MSAH	MSIAH	MSAH

مأخذ: کرولیک (۱۹۹۷: ۱۴)



نمودار ۱. ساختار معادل ANFIS

$$\begin{aligned}
 y &= \bar{w}_1(p_1x + q_1y + r_1) \\
 &+ \bar{w}_2(p_2x + q_2y \\
 &+ r_2) \\
 &= (\bar{w}_1x)p_1 \\
 &+ (\bar{w}_1y)q_1 + (\bar{w}_1)r_1 \\
 &+ (\bar{w}_2x)p_2 \\
 &+ (\bar{w}_2y)q_2 + (\bar{w}_2)r_2
 \end{aligned}
 \tag{۸}$$

که نسبت به پارامترهای نتیجه  $p_1, q_1, r_1, p_2, q_2, r_2$  خطی است. در این حالت  $S_1$  مجموعه پارامترهای مقدم (غیرخطی) و  $S_2$  مجموعه پارامترهای نتیجه (خطی) می باشد. در حرکت (گام) رو به جلو الگوریتم آموزش، خروجی های گره رو به جلو تا رسیدن به لایه ۴ حرکت می کنند و سپس پارامترهای نتیجه بر اساس روش حداقل مربعات تعیین می شود. در گام رو به عقب، سیگنال های خطا پس انتشار یافته و پارامترهای مقدم به وسیله کاهش شیب بروز می شوند. جدول (۲) فعالیت های هر گام را نشان می دهد (جانگ، ۱۹۹۷: ۶۲).

اگر مجموعه پارامترهای مدل  $S$  فرض شود، دو زیرمجموعه  $S_1$  و  $S_2$  به قسمی وجود دارد که  $S_2$  مجموعه پارامترهای خطی آن می باشد. نظریه علمی ای که در پس قانون آموزش هایبیرید قرار دارد این است که برای مقادیر ثابت معین پارامترهای مجموعه  $S_1$ ، پارامترهای مجموعه  $S_2$  می توانند به وسیله روش حداقل مربعات با تابع هدف کمینه سازی مجموع مربعات خطا، پیدا شوند و تضمین کنند که نقطه بهینه سراسری<sup>۱</sup> را به دست می دهند. هنگامی که مقادیر پارامترهای مجموعه  $S_2$  ثابت شدند، پارامترهای مجموعه  $S_1$  با روش کاهش شیب بروز می شوند (جانگ، ۱۹۹۷: ۶۰).

با توجه به ساختار ANFIS در نمودار (۱)، اگر مقادیر پارامترهای مقدم ثابت فرض شوند خروجی نهایی می تواند به صورت ترکیبی خطی از پارامترهای نتیجه نوشته شود. خروجی نهایی را می توان به صورت رابطه (۸) بازنویسی کرد.



داده می‌شود (همان، ۲۰۰۸: ۲۱۷۱).

$$MAPE = \frac{1}{n} \sum \left| \frac{Y_t - \hat{Y}_t}{Y_t} \right| \times 100 \quad (11)$$

از آنجایی که RMSE اندازه خطا را نشان می‌دهد، نسبتاً در مقایسه با دیگر معیارها برای تصمیم‌گیران مفیدتر است و به همین خاطر است که نسبت به دیگر معیارها بیشتر به کار می‌رود به طوری که کاملاً در ادبیات موضوع نیز اغلب به چشم دیده می‌شود.

#### ۴- نتایج تحقیق

##### ۴-۱- داده‌های تحقیق

داده‌های مورد نیاز به منظور مقایسه مدل‌های مذکور، شامل سری زمانی تولید ناخالص داخلی ایران<sup>۵</sup> به قیمت پایه سال ۱۳۷۶ از سال ۱۳۳۸ تا ۱۳۹۲ بوده که از پایگاه اینترنتی بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران گردآوری شده و در هر سه مدل پیش‌بینی دوره ۱۳۸۴-۱۳۳۸ به آموزش و دوره ۱۳۹۲-۱۳۸۵ به تست مدل‌ها اختصاص داده شده است. برای محاسبه نرخ رشد اقتصادی سالیانه ایران از رابطه (۱۲) استفاده شده است.

$$GGDP = (\log(GDP) - \log(GDP(-1))) \quad (12)$$

همچنین، جهت طراحی مدل ARIMA از نرم‌افزار Eviews6 و طراحی مدل‌های مارکف سوئیچینگ و ANFIS به ترتیب از نرم‌افزارهای OxMetrics6 و Matlab7 استفاده شده است.

##### ۴-۲- آزمون مانایی

در این مطالعه از نرخ رشد تولید ناخالص داخلی ایران به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶ به عنوان شاخص رشد اقتصادی ایران در دوره زمانی ۱۳۹۲-۱۳۳۸ استفاده شده است. با توجه به اینکه اولین اصل در کار با داده‌های سری‌زمانی ارزیابی مانایی سری‌زمانی است در ادامه مانایی رشد اقتصادی ایران با استفاده از آزمون‌های دیکی فولر تعمیم یافته (ADF) و فیلیپس-پرون (PP) مورد بررسی قرار گرفته است که نتایج آن در جدول (۳) نشان داده شده است. چنان که در جدول (۳) مشاهده می‌شود، هر دو آزمون ADF و PP نشان می‌دهند که متغیر سری‌زمانی رشد تولید ناخالص داخلی ایران در سطح مانا است.

#### جدول ۲. دو گام موجود در الگوریتم هایبیرید برای

ANFIS		
گام رو به جلو	گام رو به عقب	
پارامترهای مقدم	ثابت	کاهش شیب
پارامترهای نتیجه	برآوردگر حداقل مربعات	ثابت
سیگنال‌ها	خروجی سیگنال‌ها	سیگنال‌های خطا

مأخذ: جانگ (۱۹۹۷: ۶۲)

به طور خلاصه با به‌کارگیری مدل فازی سوگنو به عنوان سیستم استنتاج و ترکیب آن با برآوردگر حداقل مربعات و روش کاهش شیب، ساختار ANFIS برای مدل سازی عصبی-فازی غیرخطی و نیز به منظور پیش‌بینی سری‌های زمانی در دامنه زمان بسیار مناسب است.

##### ۳-۴- معیارهای ارزیابی کارایی مدل‌های پیش‌بینی

به هنگام مدل سازی (برازش) و همچنین پس از فرایند برازش نیاز است تا عملکرد مدل ارزیابی شود. معیارهای خطا نقش بسیار مهمی در کالیبره کردن یا پالایش یک مدل دارند به طوری که با آن می‌توان به درستی برای یک مجموعه از سری‌های زمانی پیش‌بینی کرد. از این معیارهای ارزیابی می‌توان به میانگین قدرمطلق خطا<sup>۱</sup> و جذر میانگین مجموع مربعات خطا<sup>۲</sup> و میانگین قدرمطلق درصد خطا<sup>۳</sup> اشاره کرد (آرمسترونگ و کولوپ<sup>۴</sup>، ۱۹۹۲: ۷۵). میانگین قدر مطلق خطا که با MAE نشان داده می‌شود، رابطه (۹) متوسط قدر مطلق خطاها را نشان می‌دهد (آزاده و همکاران، ۲۰۰۸: ۲۱۷۱).

$$MAE = \frac{\sum |Y_t - \hat{Y}_t|}{n} \quad (9)$$

جذر میانگین مجموع مربعات خطا (RMSE) که در رابطه (۱۰) نشان داده شده است میزان خطا به ازای هر مشاهده یعنی میانگین آنها به دست می‌آید.

$$RMSE = \sqrt{\frac{\sum (Y_t - \hat{Y}_t)^2}{n}} \quad (10)$$

میانگین قدرمطلق درصد خطا از جمله معیارهای خطای درصدی است که محبوبیت فراوانی دارد و اخیراً بسیار مورد استفاده قرار گرفته است. شاید بتوان گفت پر استفاده‌ترین معیار بدون واحد است. این معیار در رابطه (۱۱) با MAPE نشان

1. Mean Absolute Error
2. Root Mean Square Error
3. Mean Absolute Percentage Error
4. Armstrong & Collopy (1992)

ممکن پارامترهای  $p$ ،  $q$ ، را تعیین کرد. با بررسی نمودار  $ACF^2$  می توان مرتبه ترم های  $MA$  را تعیین کرد. به طور مشابه از روی نمودار  $PACF^3$  می توان مرتبه ترم های  $AR$  را تعیین کرد. با توجه به حداکثر مقادیر پارامترهای بالا می توان چندین مدل مختلف ایجاد کرد. برای این مدل ها باید معیارهای زیر را لحاظ کرد تا مدل های مجاز و مناسب برای پیش بینی حاصل شوند. این معیارها به صورت (۱): آماره  $t$  هر یک از ترم ها (۲) معیارهای انتخاب مدل مثل  $AIC$ ،  $SIC$ ،  $HQ$  (۳) آماره دورین-واتسن مدل برای بررسی خودهمبستگی (۴)  $R^2$  تعدیل شده (۵) ایستایی و معکوس پذیری ریشه های مدل برآورد شده (۶) نرمال بودن سری مانده ها با آزمون  $Normality$  (۷) خودهمبستگی در سری مانده ها با آزمون بروش-گادفری  $Serial Correlation LM$  (۸) ناهمسانی واریانس در سری مانده ها با آزمون  $ARCH LM$  می باشند.

لازم به ذکر است که آزمون خودهمبستگی بروش-گادفری از یک چارچوب عمومی تر و بهتری نسبت به آماره دورین-واتسن برای بررسی خودهمبستگی برخوردار است (راهنمای ایوبوز ۷، ۲۰۰۹، ۱۱۸). اگر در مدلی آماره  $t$  یکی از ترم های به کار رفته معنی دار نباشد یا اگر شرایط ایستایی و معکوس پذیری برای ریشه های مدل برقرار نباشد، آن مدل حذف می شود. سپس برای تمامی مدل ها سه آزمون شماره های ۶ و ۷ و ۸ انجام می شود و اگر تمامی آنها در سطح ۵٪ پذیرفته شدند مدل معتبر و قابل انتخاب است. سپس از بین مدل ها، بسته به معیارهای آمده در ۲، ۳ و ۴ می توان بهترین ها را انتخاب کرد. در این مرحله تعداد جملات میانگین متحرک ( $MA$ ) و خود رگرسیون ( $AR$ ) با استفاده از توابع  $ACF$  و  $PACF$  از روش باکس-جنکینز تعیین شده است. بهترین مدل  $ARIMA(1,0,1)$  است. آماره آزمون جارک-برا برای جمله باقیمانده خطا مدل برابر  $(0/673)$   $(0/7909)$  است. یعنی جمله باقیمانده این مدل توزیع نرمال است. پس از انتخاب بهترین مدل برازش شده در این مرحله رشد تولید ناخالص داخلی ایران برای دوره ۱۳۹۲-۱۳۸۵ پیش بینی شده است. در این مدل برای پیش بینی رشد اقتصادی ایران متغیر مجازی برای سال های رشد مثبت مقدار یک و رشد منفی مقدار صفر استفاده شد. جدول (۵) مقادیر واقعی، پیش بینی شده و خطای پیش بینی توسط مدل  $ARIMA(1,0,1)$  را در دوره مورد بررسی نشان

### جدول ۳. نتایج آزمون های ریشه واحد سری رشد تولید خالص داخلی ایران

آزمون	عرض از مبدأ	روند	آماره آزمون	P-Value	نتیجه
ADF	++	++	-۳/۹۵	۰/۰۰۳۳	ماناست
PP	++	++	-۳/۹۵	۰/۰۰۳۳	ماناست

مأخذ: یافته های تحقیق

### ۳-۴ آزمون BDS

با توجه به اینکه این مطالعه مدل خطی  $ARIMA$  را با مدل های غیر خطی  $ANFIS$  و مارکف سوئیچینگ مقایسه می کند، ابتدا باید آزمون شود که متغیر نرخ رشد اقتصادی ایران دارای روند خطی است یا غیر خطی، سپس نتایج مدل های مختلف بر این اساس مقایسه می شود. آزمون  $BDS^1$  یکی از آزمون هایی است که برای بررسی وجود روابط خطی یا غیر خطی در سری های زمانی بیشترین کاربرد را دارد. جدول (۴) نتایج این آزمون را برای رشد اقتصادی ایران نشان می دهد. همان طور که مشاهده می شود، فرضیه صفر مبنی بر اینکه رشد اقتصادی ایران دارای روند خطی است رد می شود.

### جدول ۴. نتایج آزمون BDS سری رشد تولید ناخالص داخلی ایران

Dimension	Prob.	Z-Statistic	Std. Error	BD Statistic
۲	۰/۰۰	۳/۷۵۳	۰/۰۱۱	۰/۰۳۹۹
۳	۰/۰۰	۳/۵۷	۰/۰۱۷	۰/۰۶۱
۴	۰/۰۰	۴/۲۹۶	۰/۰۲۰	۰/۰۸۸
۵	۰/۰۰	۴/۹۷۹	۰/۰۲۱	۰/۱۰۸
۶	۰/۰۰	۵/۶۰۸	۰/۰۲۱	۰/۱۱۸

مأخذ: یافته های تحقیق

یعنی با توجه به نتایج جدول بالا می توان گفت رشد اقتصادی ایران تقریباً روند غیر خطی دارد. بنابراین انتظار می رود مدل های غیر خطی عملکرد مناسب تری نسبت به مدل خطی  $ARIMA$  در پیش بینی رشد اقتصادی ایران داشته باشند.

### ۴-۴ نتایج مدل $ARIMA$

بعد از مرحله آماده سازی داده ها به مرحله ساخت مدل می رسیم. بنا بر متدولوژی باکس-جنکینز بعد از ایستاسازی داده ها، بایستی مقادیر پارامترها را تعیین کرد. برای این کار، با استفاده از چند قانون از روی همبستگی نگار می توان مقادیر

2. Autocorrelation Function  
3. Partial Autocorrelation Functions  
4. Breusch-Godfrey

1. Brock, Dechert and Scheinkman

می‌دهد.

که عموماً ۵۰ تا ۸۵ درصد تعداد داده‌ها را شامل می‌شود، دسته دوم برای تست شبکه (Testing) که در واقع وقتی دقت و خطا شبکه روی داده‌های آموزشی زیاد می‌شود برای جلوگیری از بیش-برازش (ایجاد تصادفی بودن در خط برازش) روی داده‌های تست مقدار خطا رو هم حساب می‌کند و پارامترهای شبکه‌ای که مقدار خطای تست کمتری دارند را به عنوان جواب نهایی انتخاب می‌کند. دسته سوم داده‌های اعتبارسنجی یا داده‌های چک (Checking) نام دارند که برای پیش‌بینی استفاده می‌شوند. مدل مورد استفاده برای آموزش و پیش‌بینی ANFIS یک سامانه استنتاج فازی سوگنو با تابع عضویت ورودی تفاوت دو تابع سیگموئید و توابع خروجی خطی را در یک ساختار عصبی اجرا می‌کند و برای فرایند آموزش از ترکیبی از روش‌های آموزش پس انتشار خطا و حداقل مربعات خطا استفاده می‌کند. بدین ترتیب یک سیستم عصبی فازی طراحی شده است که قابلیت یادگیری دارد و بدین صورت عمل می‌کند که در هر دور آموزش، هنگام حرکت رو به جلو خروجی‌های گره‌ها به صورت عادی تا لایه آخر محاسبه می‌شوند. و سپس پارامترهای نتیجه توسط روش کمترین مجموع مربعات خطا محاسبه می‌شوند.

در ادامه پس از محاسبه خطا در بازگشت رو به عقب نسبت خطا بر روی پارامترهای شرط، پخش شده و با استفاده از روش شیب نزولی مقدار آنها تصحیح می‌شود. برای مدل‌سازی و آموزش شبکه از طریق تغییر مداوم توابع عضویت مختلف، تعداد توابع عضویت و تعداد وقفه‌های متغیر، از طریق آزمون و خطا شبکه‌ای با سه تابع عضویت تفاوت دو تابع سیگموئید برای ورودی و توابع خطی برای خروجی و یک وقفه از متغیر ساخته شده است. جدول (۷) مقادیر واقعی و پیش‌بینی شده توسط مدل ANFIS و همچنین خطای پیش‌بینی را نشان می‌دهد.

#### جدول ۵. مقادیر واقعی، پیش‌بینی شده و خطای

##### پیش‌بینی مدل ARIMA(1,0,1)

سال	مقدار واقعی	مقدار پیش‌بینی	خطای پیش‌بینی
۱۳۸۵	۰/۰۶۴۰۴	۰/۰۶۴۹۱	-۰/۰۰۰۸۶
۱۳۸۶	۰/۰۶۴۴	۰/۰۶۵۸	-۰/۰۰۱۳۷
۱۳۸۷	۰/۰۶۰۵۲	۰/۰۶۰۶۵	-۰/۰۰۰۱۲
۱۳۸۸	۰/۰۵۷۰۷	۰/۰۵۷۳۰	-۰/۰۰۰۲۲
۱۳۸۹	۰/۰۵۳۹۹	۰/۰۵۷۹۴	-۰/۰۰۳۹۴
۱۳۹۰	۰/۰۵۱۲۲	۰/۰۵۶۵۱	-۰/۰۰۵۲۸
۱۳۹۱	-۰/۰۶۸	-۰/۰۷۳۲۳	۰/۰۰۵۲۳
۱۳۹۲	-۰/۰۲۲	-۰/۰۴۲۷۷	۰/۰۲۰۷۷

مأخذ: یافته‌های تحقیق

#### جدول ۶. مقادیر واقعی، پیش‌بینی شده و خطای

##### پیش‌بینی مدل مارکف سوئیچینگ MS-AR (3, 1)

سال	مقدار واقعی	مقدار پیش‌بینی	خطای پیش‌بینی
۱۳۸۵	۰/۰۶۴۰۴	۰/۰۶۲۷۹	۰/۰۰۱۲۵
۱۳۸۶	۰/۰۶۴۴	۰/۰۶۳۸۶	۰/۰۰۰۵۶
۱۳۸۷	۰/۰۶۰۵۲	۰/۰۶۲۲۱	-۰/۰۰۱۶۹
۱۳۸۸	۰/۰۵۷۰۷	۰/۰۵۸۴۵	-۰/۰۰۱۳۸
۱۳۸۹	۰/۰۵۳۹۹	۰/۰۵۷۴۶	-۰/۰۰۳۴۷
۱۳۹۰	۰/۰۵۱۲۲	۰/۰۵۴۳۵	-۰/۰۰۳۱۳
۱۳۹۱	-۰/۰۶۸	-۰/۰۵۹۴۳	-۰/۰۰۸۵۶
۱۳۹۲	-۰/۰۲۲	-۰/۰۲۰۳۴	-۰/۰۰۱۶۵

مأخذ: یافته‌های تحقیق

#### ۴-۵- نتایج مدل مارکف سوئیچینگ

طبق استراتژی انتخاب مدل که در بخش معرفی روش و مدل تحقیق به آن اشاره گردید مدل بهینه با ۴ وقفه برای متغیر رشد اقتصادی ایران و تعداد انتخاب شده رژیم بهینه نیز ۳ می‌باشد (MS(3)-AR(1)). جدول (۶) نتایج حاصل از تخمین مدل مارکف سوئیچینگ را نشان می‌دهد.

#### ۴-۶- مدل ANFIS

داده‌های مورد استفاده در تحقیق به سه دسته مجزا از هم تفکیک می‌شوند. یک دسته برای آموزش شبکه (Training)

#### ۴-۷- مقایسه عملکرد مدل‌های مختلف پیش‌بینی

در این بخش با توجه به نتایج به دست آمده از روش‌های مختلف در پیش‌بینی رشد اقتصادی ایران به مقایسه عملکرد این مدل‌ها با استفاده از معیارهای MAE، RMSE و MAPE پرداخته شده است. که نتایج این معیارها در جدول (۸) برای مدل‌های مختلف آورده شده است. همان‌طور که در جدول (۸) مشاهده می‌شود هر کدام از مقادیر معیارهای مربوط به مدل پیش‌بینی ANFIS کمترین مقدار را دارا می‌باشند بنابراین، این مدل به عنوان بهترین مدل انتخاب می‌شود. نکته

اقتصادی ایران از طریق رویکرد تک متغیری با استفاده از روش های ARIMA، مارکف سوئیچینگ و ANFIS طی دوره ۱۳۹۲-۱۳۸۳ است. بدین منظور از معیارهای ارزیابی عملکرد مدل های پیش بینی RMSE، MAE و MAPE استفاده شده است. از میان این سه روش مشاهده شد که روش ANFIS در پیش بینی خطای کمتری دارد و به عنوان بهترین روش انتخاب شد. نتیجه دیگری که می توان از این مطالعه گرفت مقادیر معیارهای خطای کمتر مدل مارکف سوئیچینگ نسبت به مدل ARIMA می باشد که با توجه به اینکه مدل مارکف سوئیچینگ غیر خطی می باشد می توان رابطه غیر خطی بین روند رشد اقتصادی ایران را نتیجه گرفت.

### ۶- پیشنهادات

با توجه به دقت پیش بینی بالاتر الگوریتم پیشنهادی این مطالعه، استفاده از این تکنیک در پیش بینی سایر متغیرهای اقتصادی پیشنهاد می گردد. نهایتاً پیشنهاد می شود روش های جدید پیش بینی متغیرهای اقتصادی از جمله روش های ترکیبی که هر کدام دارای مزیت هایی در پیش بینی هستند و امکان پیش بینی دقیق تر را فراهم می کنند، برای مطالعات آتی بیشتر استفاده شود تا شرایط لازم برای تصمیم گیری و سیاست گذاری مناسب فراهم شود. با توجه به اینکه متوسط رشد بلندمدت اقتصادی کشور طی سال های پس از بازسازی جنگ تحمیلی (سال های ۱۳۹۰-۱۳۷۱) ۳/۷ درصد در سال بوده، محاسبات صورت گرفته در مورد عناصر اصلی تشکیل دهنده رشد اقتصادی ایران در بیش از پنج دهه گذشته نشان می دهد که رشد موجودی سرمایه، عامل اصلی شکل دهنده رشد اقتصادی کشور بوده است. به گونه ای که میزان رشد موجودی سرمایه و رشد اقتصادی بسیار نزدیک به یکدیگر حرکت کرده اند. از آنجا که انباشت سرمایه فیزیکی، تقریباً به طور مستمر در حال افزایش بوده است، میزان رشد اقتصادی مثبتی برای کشور به وجود خواهد آورد. بر این اساس پیشنهاد سیاستی بر پایه توجه به مقوله سرمایه گذاری و حمایت از بنگاه های اقتصادی و تولیدات داخلی می باشد.

قابل توجه دیگر این است که روش مارکف سوئیچینگ اگر چه نسبت به روش ARIMA عملکرد بهتری دارد اما نسبت به روش ANFIS عملکرد ضعیف تری دارد.

### جدول ۷. مقادیر واقعی، پیش بینی شده و خطای

#### پیش بینی مدل شبکه عصبی-فازی ANFIS

سال	مقدار واقعی	مقدار پیش بینی	خطای پیش بینی
۱۳۸۵	۰/۰۶۴۰۴	۰/۰۶۳۵۷	۰/۰۰۰۴۷
۱۳۸۶	۰/۰۶۴۴	۰/۰۶۴۶۵	-۰/۰۰۰۲۲
۱۳۸۷	۰/۰۶۰۵۲	۰/۰۶۰۴۳	۰/۰۰۰۰۹
۱۳۸۸	۰/۰۵۷۰۷	۰/۰۵۸۳۰	-۰/۰۰۱۲۲
۱۳۸۹	۰/۰۵۳۹۹	۰/۰۵۴۵۰	-۰/۰۰۰۵۱
۱۳۹۰	۰/۰۵۱۲۲	۰/۰۵۲۳۴	-۰/۰۰۱۱۲
۱۳۹۱	-۰/۰۰۶۸	-۰/۰۰۷۳۸۱	۰/۰۰۵۸۱
۱۳۹۲	-۰/۰۰۲۲	-۰/۰۰۲۷۶۵	۰/۰۰۵۶۵

مأخذ: یافته های تحقیق

### جدول ۸. مقایسه عملکرد روش های مختلف در پیش بینی رشد اقتصادی ایران

معیار	ANFIS	MS	ARIMA
MAE	۰/۰۰۴۷۲	۰/۰۰۲۷۱	۰/۰۰۱۸۹
RMSE	۰/۰۰۷۹۴	۰/۰۰۳۶۱	۰/۰۰۲۹۳
MAPE	۱۵/۴۷۵۷	۵/۰۸۸۸۶	۵/۱۰۰۰۷

مأخذ: یافته های تحقیق

### ۵- بحث و نتیجه گیری

داده های حساب ملی یکی از مهم ترین ابزارهای آماری در برنامه ریزی و سیاست گذاری های اقتصادی است. از این رو پیش بینی متغیرهای عمده از اهمیت خاصی برخوردار است. رشد اقتصادی از مهم ترین متغیرهای اقتصادی است که همواره مورد توجه سیاست گزاران بوده و پیش بینی آن از اولویت بالایی برخوردار است. از آنجا که پیش بینی بر اساس مدل های چند متغیر اقتصادسنجی با محدودیت های زیادی همراه است، هدف اصلی این مطالعه شناسایی روش مناسب برای پیش بینی رشد

### منابع

پژوهشی پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، سال چهارم، شماره ۱۶، ۴۰-۲۱.

جعفری صمیمی، احمد؛ طهرانچیان، امیرمنصور و قادری، سامان (۱۳۹۳). "اثرات نامتقارن کل های پولی دیویژیا بر تورم در ایران: کاربرد روش چرخشی مارکوف". فصلنامه علمی

- مهدیلو، علی؛ صادقی، حسین و عصارای آرانی، عباس (۱۳۹۴). "برآورد تأثیر غیرخطی فرصت‌های رانت‌جویی بر رشد اقتصادی در ایران با استفاده از مدل مارکف سوئیچینگ". فصلنامه علمی پژوهشی پژوهش‌های رشد و توسعه اقتصادی، سال پنجم، شماره ۱۸، ۳۰-۱۱.
- Abeyasinghe, T. (1998). "Forecasting Singapore's Quarterly GDP with Monthly External Trade". *International Journal of Forecasting*, 14(3), 505-513.
- Armstrong, J. S. & Collopy, F. (1992). "Error Measures for Generalizing about Forecasting Methods: Empirical Comparisons". *International Journal of Forecasting*, 8(1), 69-80.
- Azadeh, A., Saberi, M., Ghaderi, S. F., Gitiforouz, A. & Ebrahimipour, V. (2008). "Improved Estimation of Electricity Demand Function by Integration of Fuzzy System and Data Mining Approach". *Energy Conversion and Management*, 49(8), 2165-2177.
- Baffigi, A., Golinelli, R. & Parigi, G. (2004). "Bridge Models to Forecast the Euro Area GDP". *International Journal of Forecasting*, 20(2), 447-460.
- Banbura, M. & Runstler, G. (2011). "A Look into the Factor Model Black Box: Publication Lags and the Role of Hard and Soft Data in Forecasting GDP". *International Journal of Forecasting*, 27, 333-346.
- Barhoumi, K., Darne, O. & Ferrara, L. (2010). "Are Disaggregate Data Useful for Factor Analysis in Forecasting French GDP". *Journal of Forecasting*, 29(2), 132-144.
- EViews 7 User's Guide II (2009). "Quantitative Micro Software", LLC.
- Gan, W. B. & Wong, F. C. (1993). "A Bayesian Vector-autoregression Model for Forecasting Quarterly GDP". *The Singapore Experience. Singapore Economic Review*, 38(2), 15-34.
- Giovanis, E. (2010). "Application of Adaptive Network-based Fuzzy Inference System in Macroeconomic Variables Forecasting".
- جهانیان، ناصر (۱۳۸۸). "اسلام و رشد عدالت محور". تهران، سازمان انتشارات پژوهشگاه فرهنگ و اندیشه اسلامی، شماره ۱، جلد اول.
- قره‌باغیان، مرتضی (۱۳۷۲). "رشد نوین اقتصادی". تهران، خدمات فرهنگی رسا، شماره ۱، جلد دوم.
- World Academy of Science. Engineering and Technology*, 64, 660-667.
- Hamilton, J. (1989). "A New Approach to The Economic Analysis of Nonstationary Time Series and The Business Cycle". *Econometrica: Journal of the Econometric Society*, 57(2), 357-384.
- Hamzacebi, C. (2008). "Improving Artificial Neural Networks' Performance in Seasonal Time Series Forecasting". *Information Sciences*, 178(23), 4550-4559.
- Hukkinen, J. & Viren, M. (1999). "Assessing the Forecasting Performance of a Macroeconomic Model". *Journal of Policy Modeling*, 21(1), 753-768.
- Jafari-Samimi, A., Shirazi, B. & Fazlollahtabar, H. (2007). "A Comparison between Time Series, Exponential Smoothing and Neural Network Methods to Forecast GDP of Iran". *Iranian Economic Review*, 12(19), 19-35.
- Jang, J. S. R., Sun, C. T. & Mizutani, E. (1997). "Neuro-Fuzzy and Soft Computing: A Computational Approach to Learning and Machine Intelligence", *Prentice Hall*.
- Jones, I. C. (1997). "Introduction to Economic Growth". New York: W.W. Norton and Co. First Edition.
- Kang, C. S. A. (1980). "Identification of Autoregressive Integrated Moving Average Time Series". Ph.D. Thesis, Arizona State University.
- Krolzig, H. (1997). "Markov-Switching Vector Autoregressions: Modelling, Statistical Inference, and Application to Business Cycle Analysis". Springer, Berlin.
- Mirbagheri, M. (2010). "Fuzzy-Logic and Neural Network Fuzzy Forecasting of Iran

- GDP Growth”. *African Journal of Business Management*, 4(6), 925-929.
- Pouzols, F. M., Lendasse, A. & Barros, A. B. (2008). “Autoregressive Time Series Prediction by Means of Fuzzy Inference Systems Using Estimation of Electricity Demand Function by Integration of Fuzzy System and Data Mining Approach”. *Energy Conversion and Management*, 49(2), 2165–2177.
- Qin, D., Cegas, M. A., Ducanes, G., Magtibay-Ramos, N. & Quising, P. (2008). “Automatic Leading Indicators versus Macroeconometric Structural Models: A Comparison of Inflation and GDP Growth Forecasting”. *International Journal of Forecasting*, 24(3), 399–413.
- Schumacher, C. (2007). “Forecasting German GDP Using Alternative Factor Models Based on Large Datasets”. *Journal of Forecasting*, 26(1), 271–302.
- Schumacher, C. (2008). “Real-time Forecasting of German GDP Based on a Large Factor Model with Monthly and Quarterly Data”. *International Journal of Forecasting*, 24(3), 386–398.
- Schumacher, C. (2010). “Factor Forecasting Using International Targeted Predictors: The Case of German GDP”. *Economics Letters*, 107(2), 95–98.
- Stock, J. H. & Watson, M. W. (2003). “Forecasting Output and Inflation: the Role of Asset Prices”. *Journal of Economic Literature*, 41(3), 788–829.
- Swanson, N. R. & White, H. (1997). “A Model Selection Approach to Real-Time Macroeconomic Forecasting Using Linear Models and Artificial Neural Networks”. *The Review of Economics and Statistics*, 79(1), 540-550.
- Wang, Ch. (2011). “A Comparison Study between Fuzzy Time Series Model and ARIMA Model for Forecasting Taiwan Export”. *Expert Systems with Applications*, 38(8), 9296–9304.
- Zhang, G. P. & Qi, M. (2005). “Neural Network Forecasting for Seasonal and Trend Time Series”. *European Journal of Operational Research*, 160(2), 501-514.