

پیش بینی واردات برنج با روش‌های ARIMA و هالت وینترز

عبدالرحمن حاجیلی دوجی *، 219،

1393-6-11

در این پژوهش به پیش‌بینی ارزش واردات برنج برای 5 سال آینده با استفاده از ارزش واردات این محصولات طی دوره 1360-1391 مبادرت شده است. برای انجام پیش بینی ابتدا پیش بینی پذیر بودن سری‌ها به وسیله آزمون تصادفی بودن والد-ولفویترز بررسی شد. سپس روش‌های رگرسیونی غیرعلی شامل ARMA و ARIMA و هم‌چنین روش‌های غیر رگرسیونی هالت وینترز با هم بر اساس حداقل میانگین مجذور خطا مقایسه شد، نهایتاً بهترین مدل پیش بینی برای هر سری از داده‌ها انتخاب شد و بر اساس آن پیش‌بینی برای 5 سال آینده انجام شد. نتایج پژوهش نشان می‌دهد که ارزش واردات برنج بر اساس آزمون والد-ولفویترز غیر تصادفی بوده و پیش‌بینی پذیر است. سپس برای پیش‌بینی ارزش واردات برنج ایستایی داده‌ها با آزمون دیکی فولر تعمیم یافته بررسی شد، که ارزش واردات برنج در سطح و با عرض از مبدا و بدون تفاضل‌گیری در سطح خطای 5 درصد ایستا شد. پس از آن روش‌های پیش بینی با معیار حداقل میانگین مجذور خطا با هم مقایسه شد که برای سری ارزش واردات برنج روش ARMA به عنوان بهترین مدل انتخاب شد. در پایان با استفاده از روش منتخب پیش‌بینی برای 5 سال آینده انجام شد که ارزش واردات برنج برای سال‌های آینده روند صعودی دارد.

کلمات کلیدی : واردات برنج، آزمون والد-ولفویترز- آزمون دیکی فولر

[Islamic Azad University, Rasht Branch - Thesis Database](#)

[دانشگاه آزاد اسلامی واحد رشت - سامانه بانک اطلاعات پایان نامه‌ها](#)