

تخمین شاخص سود محصول مبتنی بر شاخص پیچیدگی محصول

ثریا جلوزان : گروه حسابداری، واحد سنندج، دانشگاه آزاد اسلامی، سنندج، ایران.
عطاله محمدی ملقرنی* : گروه حسابداری، واحد سنندج، دانشگاه آزاد اسلامی، سنندج، ایران.
بهروز شاهمرادی : گروه تامین مالی و اقتصاد علم، موسسه تحقیقات سیاست علمی کشور، تهران، ایران.

چکیده

سود در صورت‌های مالی به عنوان یکی از مهمترین معیارهای ارزیابی عملکرد و تعیین کننده ارزش بنگاه اقتصادی تلقی میگردد. هدف اصلی پژوهش تعیین میزان سود یک محصول بر پایه شاخص پیچیدگی محصول با توجه به تنوع و فراگیری محصول در بازارهای مختلف برای جامعه آماری ۵۰۰ شرکت سودده موجود در لیست فورچون از سال مالی ۲۰۱۴ تا پایان سال ۲۰۱۸ با استفاده از داده‌های تابلویی و تلفیقی انتخاب گشتند. در این مطالعه سعی شده تا با برآورد سود هر محصول به سرمایه‌گذاران این اختیار را دهد که بهترین محصول با سودآوری بیشتر را جهت سرمایه‌گذاری با توجه به سودآوری آن مبتنی بر شاخص پیچیدگی محصول انتخاب کنند. یافته‌ها نشان می‌دهد در نظر گرفتن رویکرد جدید تولید محصولات با پیچیدگی بالا نسبت به انتخاب نوع محصول و فعالیت واحد اقتصادی و اندازه‌گیری شاخص سودآوری محصول تولیدی، با بررسی رابطه پیچیدگی محصولات و سودآوری آنها با معرفی شاخص جهت تخمین سود محصول برای سرمایه‌گذاران که مهم‌ترین استفاده‌کنندگان اطلاعات مالی می‌باشند با تصمیم‌گیری بهینه با توجه به ترکیب محصولات و انتخاب نوع محصول جهت تولید در شرکت‌های که سود بالاتری دارند، احتمالاً منابع را به‌طور مؤثرتری تخصیص می‌دهند، که این امر می‌تواند به رشد اقتصادی کلی کمک کند. نتایج مبین رابطه مثبت و معنی‌داری بین متغیرهای سود عملیاتی و شاخص پیچیدگی محصول و تخمین سود بر پایه تنوع و فراگیری محصول است.

کلیدواژه‌ها: پیچیدگی اقتصادی؛ شاخص سودآوری محصول؛ شاخص پیچیدگی محصول؛ کد سیستم هماهنگ.

طبقه‌بندی JEL: D2, G17, M41

* mohammadiata117@gmail.com

تأثیر هوش مصنوعی بر بهره‌وری کل عوامل در صنایع ایران

فروغ اسمعیلی صدرآبادی* : دانشکده علوم انسانی و اجتماعی، دانشگاه اردکان، اردکان، ایران.
مانده‌خناری : دانشکده اقتصاد و علوم سیاسی، دانشگاه شهید بهشتی، تهران، ایران.

چکیده

هوش مصنوعی (AI) بر بهره‌وری کل عوامل (TFP) در صنایع ایران از سال ۱۹۹۷ تا ۲۰۲۰ می‌پردازد و از یک مجموعه داده جامع که بر اساس کدهای چهاررقمی طبقه‌بندی بین‌المللی صنایع (ISIC) سازماندهی شده است، استفاده می‌کند. ما از روش GMM برای مقابله با چالش‌هایی مانند درون‌زایی و هم‌خطی در یک مجموعه داده شامل بیش از ۲۰۰ متغیر مقطعی استفاده می‌کنیم. نتایج ما نشان می‌دهد که هم سرمایه‌گذاری‌های فیزیکی و هم سرمایه‌گذاری‌های غیرملموس تأثیر قابل توجهی بر TFP دارند؛ به‌طوری‌که افزایش ۱٪ در سرمایه‌گذاری فیزیکی منجر به افزایش ۵۱۴٪ در TFP می‌شود، در حالی که سرمایه‌گذاری غیرملموس بهبود ۲۸۸٪ را به همراه دارد. یکی از نوآوری‌های کلیدی این تحقیق معرفی یک متغیر اندازه‌گیری AI در تابع تولید است که از روش Hulten، Corrado و Sichel (CHS) برای ارزیابی روشن‌تری از تأثیرات بهره‌وری AI استفاده می‌کند. اگرچه سرمایه‌گذاری در AI به‌طور مثبت با TFP همبستگی دارد، تأثیر فعلی آن محدود است که نشان‌دهنده پذیرش تدریجی فناوری‌های پیشرفته در صنایع ایران است. این موضوع نیاز به یک استراتژی جامع برای بهره‌برداری کامل از مزایای بهره‌وری AI را برجسته می‌کند. ما سیاست‌هایی را برای تسهیل ادغام فناوری و تخصص‌گرایی نیروی کار، از جمله سرمایه‌گذاری در آموزش، ارائه مشوق‌هایی برای پذیرش AI و ترویج همکاری بین صنعت و مؤسسات آموزشی به‌منظور افزایش بهره‌وری و رقابت‌پذیری در بازار جهانی توصیه می‌کنیم.

کلیدواژه‌ها: هوش مصنوعی (AI)، بهره‌وری کل عوامل (TFP)، صنایع ایرانی؛ سرمایه‌گذاری‌های مشهود و نامشهود؛ روش گشتاورهای تعمیم یافته (GMM).

طبقه‌بندی JEL: O43، O14، O11، L60

* f.esmaeily@ardakan.ac.ir

نقش حکمرانی خوب در رشد اقتصادی: شواهدی از گروه های درآمدی

حسن دلیری* : دانشکده علوم انسانی و اجتماعی، دانشگاه گلستان، گرگان، ایران.

چکیده

این مطالعه به بررسی تأثیر شاخص های حکمرانی خوب بر رشد اقتصادی در گروه های مختلف درآمدی می پردازد. با استفاده از برآورد داده های پانل پویا با روش سیستم یک مرحله ای GMM، داده های کشورهای کم درآمد (۱۵ کشور)، با درآمد متوسط پایین (۴۰ کشور)، با درآمد متوسط بالا (۴۰ کشور) و پردرآمد (۵۲ کشور) را در دوره ۲۰۰۷-۲۰۲۲ تجزیه و تحلیل می کنیم. یافته ها حاکی از آن است که شاخص های حکمرانی بسته به گروه درآمدی تأثیرات متفاوتی بر رشد اقتصادی دارند. تجزیه و تحلیل نشان می دهد که تأثیر شاخص های حکمرانی بر رشد اقتصادی به طور قابل توجهی در گروه های درآمدی متفاوت است. در اقتصادهای کم درآمد، «کنترل فساد» و «کیفیت نظارتی» قوی ترین تأثیرات مثبت را دارند و بر نقش حیاتی بهبودهای حاکمیتی در تقویت رشد در این محیط ها تأکید می کنند. برای اقتصادهای با درآمد متوسط پایین، «حاکمیت قانون» و «اثربخشی دولت» محرک های کلیدی هستند که نشان دهنده اهمیت چارچوب های قانونی و خدمات عمومی کارآمد در دوران گذار اقتصادی است. در اقتصادهای با درآمد متوسط رو به بالا، «اثربخشی دولت» و «صدا و مسئولیت پذیری» قابل توجه هستند، اگرچه ضرایب متوسط نشان می دهد که محدودیت های ساختاری و خارجی نقش حکمرانی را در محرک رشد محدود می کند. برای اقتصادهای پردرآمد، «کیفیت نظارتی»، «حاکمیت قانون» و «ثبات سیاسی» برای حفظ رشد ضروری هستند. جالب توجه است که COVID-19 تأثیر منفی قابل توجهی بر رشد اقتصادی در همه گروه ها داشت، اگرچه میزان آن متفاوت بود. نتایج نشان می دهد که با کاهش سطح درآمد کشورها، تأثیر منفی شوک کرونا بر رشد اقتصادی افزایش یافته است.

کلیدواژه ها: حکمرانی خوب؛ رشد اقتصادی؛ پانل پویا، کوپید ۱۹.

طبقه بندی JEL: D73، H11، O11، O43، P16

* H.daliri@gu.ac.ir

تأثیر اعتبار بخش خصوصی بر خوداشتغالی در ایران: رویکرد ترکیبی

هوش مصنوعی با مدل فضایی

رضا طاهری هفت آسیایی* : دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.

آمینه نادری : دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.

یوسف محمدزاده : دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.

اکبر زواری رضایی : دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.

چکیده

خوداشتغالی نقش مهمی در اقتصاد ایران دارد و درک عوامل موثر بر آن از اهمیت زیادی برخوردار است. این مطالعه با هدف بررسی تأثیر اعتبارات بخش خصوصی بر خوداشتغالی در ایران با استفاده از تکنیک های هوش مصنوعی مانند شبکه های عصبی مصنوعی، شبکه های عصبی عمیق و الگوریتم های یادگیری ماشین امکان شناسایی روابط غیرخطی و الگوهای پیچیده در داده ها را فراهم کرد. همچنین مدل های اقتصادسنجی فضایی SAR، SEM و SDM بادر نظر گرفتن وابستگی های مکانی بین استان ها و بررسی اثرات سرریز فضایی استفاده مربوط به دوره زمانی ۱۹۹۰ تا ۲۰۲۳ در سطح استان های کشور صورت گرفته است. یافته ها حاکی از رابطه منفی و معنادار بین نسبت تسهیلات خرد به تولید ناخالص داخلی و نرخ خوداشتغالی است. همچنین ضرایب منفی شاخص باز بودن اقتصادی و نرخ تشکیل سرمایه، اثر منفی آنها بر خوداشتغالی را نشان می دهد. در مقابل، متغیرهای بهره وری کل عوامل تولید و مخارج آموزشی تأثیر مثبت و معناداری بر نرخ خوداشتغالی دارند. نتایج مدل های فضایی نیز بیانگر وابستگی نرخ خوداشتغالی در مناطق مختلف کشور به یکدیگر است. بنابراین، این مطالعه رابطه منفی بین این دو را نشان داد که می تواند ناشی از ناکارآمدی در ارائه تسهیلات خرد و عدم تمرکز کافی آن بر ایجاد مشاغل پایدار و مولد باشد. افزایش باز بودن اقتصادی و نرخ های بالاتر تشکیل سرمایه نیز با تشدید رقابت خارجی و تشویق سرمایه گذاری در بخش های بزرگتر اقتصادی، اثر منفی بر خوداشتغالی دارند.

کلیدواژه ها: دسترسی به امور مالی؛ خوداشتغالی؛ کاربردهای هوش مصنوعی؛ تحلیل فضایی؛ تامین مالی خرد.

طبقه بندی JEL: G21, G28, J24, O33, R15

* htaheri.reza7@gmail.com

مشارکت کودکان در بازار کار ایران، بررسی عوامل محیطی و فردی

ملیحه حدادمقدم* : گروه جمعیت شناسی، دانشگاه تهران، تهران، ایران.
پدرام داودی : پژوهشگاه قوه قضائیه، تهران، ایران.

چکیده

پدیده کار کودکان و کودکان خیابانی یکی از چالش‌های اساسی در بیشتر شهرهای بزرگ معاصر در سراسر جهان است. شیوع این پدیده به حدی افزایش یافته که هم جوامع توسعه‌یافته و هم در حال توسعه را درگیر نموده است. کار کودکان به هر شکلی از به‌کارگیری کودکان در فعالیت‌هایی که از نظر ذهنی، جسمی، اجتماعی یا اخلاقی خطرناک است و آنها را از کودکی و مشارکت مستمر در آموزش محروم می‌کند، اطلاق می‌شود. در این مطالعه، تلاش شده است تا با استفاده از داده‌های موجود مربوط به کار کودکان (داده‌های خرد از بررسی نیروی کار از سال‌های ۱۳۹۵ تا ۱۳۹۹ استفاده شده است)، مروری بر وضعیت این کودکان در ایران ارائه شود. سپس، با استفاده از رگرسیون لجستیک، عوامل فردی و خانوادگی مؤثر بر کار کودکان مورد بررسی قرار گرفته است. در مدل کلی، مهاجرت (هم بین‌المللی و هم داخلی)، عدم تحصیلات سرپرست خانوار، و زندگی در مناطق روستایی به عنوان مهم‌ترین عوامل محیطی مؤثر بر مشارکت کودکان در بازار کار شناسایی شده‌اند. در مناطق شهری، مهم‌ترین عوامل محیطی مؤثر بر مشارکت کودکان به ترتیب اهمیت، مهاجرت (هم بین‌المللی و هم داخلی) و بیکاری سرپرست خانوار بودند. در مناطق روستایی، متغیرهای محیطی کلیدی که باعث افزایش مشارکت کودکان می‌شدند شامل سطح تحصیلات سرپرست خانوار، مهاجرت و بیکاری سرپرست خانوار بودند. تحلیل الگوهای شهری و روستایی به طور جداگانه و اجتناب از خطاهای تجمیعی، اهمیت بالای عوامل اقتصادی در کار کودکان را برجسته می‌کند.

کلیدواژه‌ها: کار کودکان؛ کودکان خیابانی؛ اقتصاد خانوار؛ رگرسیون لجستیک.

طبقه‌بندی JEL: J22, J13, J24, J21

* m.h.moghadam@ut.ac.ir

رابطه بین تورم شاخص قیمت مصرف کننده و تورم شاخص قیمت تولیدکننده در ایران: آیا تورم با رشد نقدینگی لنگر شده است یا با رشد نرخ ارز؟

محمدامین شجاعی نیا *

: دانشکده اقتصاد، دانشگاه تهران، تهران، ایران.

احمد برکیش

: موسسه عالی آموزش و پژوهش، مدیریت و برنامه ریزی، تهران، ایران.

ابوالحسن والی زاده

: موسسه عالی آموزش و پژوهش، مدیریت و برنامه ریزی، تهران، ایران.

چکیده

در دو دهه اخیر مهمترین سوالی که اذهان اقتصاددانان را درگیر کرده است؛ رابطه سه گانه تورم، رشد نرخ ارز و رشد نقدینگی است. برای پاسخ به این سوال در این پژوهش میزان توضیح دهندگی تورم شاخص قیمت مصرف کننده (CPI) و تورم شاخص قیمت تولیدکننده (PPI) توسط رشد نرخ ارز و رشد نقدینگی در ایران طی سال های ۱۳۸۳ تا ۱۴۰۱ در فرکانس ماهانه بررسی شده است. بدین منظور با استفاده از تبدیل موجک پیوسته (CWT)، رابطه پویا بین این دو شاخص در باندهای فرکانسی مختلف تحلیل شده و سپس اثر رشد نرخ ارز و رشد نقدینگی بر آن کنترل شده است. همچنین به منظور اعتبارسنجی یافته ها، از مدل خودرگرسیون برداری با متغیرهای برونزا (VARX) و آزمون علیت گرنجر استفاده شده است. شاخص قیمت مصرف کننده و قیمت تولیدکننده در سه دسته مجزای کالاها، خدمات و کل (میانگین موزون دو مورد اول) بررسی شده اند. نتایج نشان می دهد که ارتباط بین تورم شاخص قیمت مصرف کننده و تورم قیمت تولیدکننده در بخش کالاها قوی تر از بخش خدمات است. همچنین، رشد نقدینگی و رشد نرخ ارز از طریق مکانیسم های تحریک تقاضا و فشار هزینه بر تورم تأثیر می گذارند. در نهایت، یافته ها حاکی از آن است که در سال های اخیر، رشد نرخ ارز نقش غالب تری نسبت به رشد نقدینگی در شکل گیری تورم داشته است، که نشان دهنده تأثیر بیشتر عوامل فشار هزینه بر تورم در این دوره است.

کلیدواژه ها: تورم شاخص قیمت مصرف کننده؛ تورم شاخص قیمت تولیدکننده؛ رشد نرخ ارز؛ رشد نقدینگی؛ تحلیل موجک پیوسته.

طبقه بندی JEL: C10, C22, E31, E52, F31

* ma.shojaeenia@ut.ac.ir

عدم قطعیت قیمت نفت و تولید صنعتی در کشورهای صادرکننده نفت

مطالعه موردی: کشورهای منتخب خاورمیانه و OECD

حمیدرضا پناه* : گروه نفت و گاز، واحد مرودشت، دانشگاه آزاد اسلامی، مرودشت، ایران.
نعمت الله موسوی : گروه اقتصاد کشاورزی، واحد مرودشت، دانشگاه آزاد اسلامی، مرودشت، ایران.
بهالالدین نجفی : گروه اقتصاد کشاورزی، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.

چکیده

نفت سهم زیادی از کل مصرف انرژی جهان را در اختیار دارد. از این جهت بدیهی است هرگونه نوسان در روند تقاضا، عرضه، قیمت و سایر متغیرهای تاثیرگذار بر این بخش نیز آثار بسیاری بر اقتصاد کشورهای تولیدکننده و مصرف‌کننده نفت دارد. هر عاملی که موجب بروز اختلال در عرضه و یا تقاضای نفت و در پی آن در بازار شود در بیشتر موارد به تغییر (کاهش یا افزایش) در قیمت منتهی می‌شوند. این تغییرات قیمت به دلیل عامل تعیین‌کنندگی قیمت در دو طرف عرضه و تقاضای بازار انرژی، آثاری بر رفتار تولیدکنندگان و مصرف‌کنندگان انرژی داشته است. این مطالعه همبستگی میان متغیر با زمان بین قیمت جهانی نفت و بازده شاخص تولید صنعتی (GDP واقعی) در کشورهای صادرکننده نفت (ایران، عربستان سعودی، امارات) و کشورهای OECD بررسی می‌کند. از این رو، در این مطالعه با استفاده از داده‌های ماهانه قیمت نفت جهانی، بازده شاخص تولید صنعتی کشورهای خاورمیانه و OECD از سال ۲۰۲۱-۲۰۰۰ و با بکارگیری نرم‌افزار Oxmetrics، همبستگی متغیر با زمان قیمت جهانی نفت و بازده شاخص تولید صنعتی در کشورهای منتخب با روش CDCC-GARCH بررسی شده است. نتایج نشان داد که همبستگی شرطی میان متغیر زمان با قیمت جهانی نفت و تولید ناخالص داخلی واقعی است و تغییرات در قیمت نهایی نفت سبب تغییرات قابل توجهی در همبستگی پویا بین متغیرها بصورت عدم قطعیت شده است.

کلیدواژه‌ها: قیمت نفت؛ شاخص تولید صنعتی؛ ایران؛ کشورهای OECD.

طبقه‌بندی JEL : Q43، O13، F14، C33

* m.f.panah1969@gmail.com

ارزیابی هزینه‌های زیست‌محیطی و اجتماعی - اقتصادی تجارت بین‌الملل: نگرش‌هایی از

انتشار کربن در ایران

رضا زینلزاده* : گروه اقتصاد دانشگاه آزاد اسلامی واحد کرمان، کرمان، ایران.

محمد رحیمی قاسم آبادی : گروه اقتصاد دانشگاه آزاد اسلامی واحد کرمان، کرمان، ایران.

زین‌العابدین صادقی : گروه اقتصاد دانشگاه شهید باهنر کرمان، کرمان، ایران.

محسن زاینده‌رودی : گروه اقتصاد دانشگاه آزاد اسلامی واحد کرمان، کرمان، ایران.

چکیده

در عصر مدرن، افزایش اطلاعات حفاظت از محیط زیست منجر به انجام ابتکارات زیست محیطی توسط کشورها و شرکت‌های مختلف با هدف افزایش عملکرد زیست محیطی شده است. این مطالعه به بررسی ارزش‌های پولی محیطی و اجتماعی-اقتصادی مرتبط با انتشار کربن تولید شده در فعالیت‌های مورد نیاز برای صادرات ایران پرداخته است. ارزش پولی خسارات ناشی از آلودگی هوا مورد توجه قرار گرفته است و در این تحقیق به آسیب‌های مالی آلودگی پرداخته می‌شود. این رویکرد به ما امکان می‌دهد خسارت‌ها را با اثرات اقتصادی تجارت مقایسه و صنایع آلاینده را شناسایی کنیم و شاخص‌های تراز تجاری را با دامنه وسیع‌تری محاسبه کنیم. لذا از جدول داده-ستانده استفاده و میزان آلودگی صنایع مختلف را محاسبه کردیم. نتایج نشان می‌دهد که خسارات ناشی از تجارت بین‌الملل به حدی قابل توجه است که نمی‌توان از آن غفلت کرد. آمارهای اقتصادی ایران در سال ۱۳۹۴ نشان می‌دهد که خسارت‌های کاهش یافته با واردات ۲۴۳۲ میلیون دلار بوده و در عین حال صادرات نیز ۳۴۴۸ میلیون دلار خسارت وارد کرده است. در حالی که اگر واردات در داخل کشور تولید شده بود، ۲۴۳۹ میلیون دلار خسارت و ۲۰۴۹ میلیون دلار ارزش افزوده (VIM) ایجاد می‌شد. خسارات خالص ایجاد شده توسط تجارت بالغ بر ۱۰۰۸ میلیون دلار است که ۰.۸۴ درصد از ارزش افزوده خالص ایجاد شده توسط تجارت کشاورزی را تشکیل می‌دهد. علاوه بر این، نتایج نشان می‌دهد که هر ۱ میلیون دلار ارزش افزوده خالص تولید شده توسط تجارت باعث خسارت خالص ۰.۳۲۱ میلیون دلاری مربوط به انتشار آلاینده شده است.

کلیدواژه‌ها: تجارت؛ صادرات؛ واردات؛ آلودگی هوا.

طبقه‌بندی JEL : Q53, Q52, F18, F10

* zeynalzadeh@yahoo.com

مدل سازی نرخ معافیت ماده ۸۴ و تعیین تبصره ماده ۱۰۰ ق.م.م

صلاح سلیمیان* : دانشکده اقتصاد، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.
محمدهادی سبحانیان : دانشکده مدیریت، دانشگاه خوارزمی، تهران، ایران.

چکیده

تبصره ماده ۱۰۰ و میزان معافیت حقوق در ماده ۸۴ قانون مالیات‌های مستقیم، از انواع مشوق‌های مالیاتی است که سازمان امور مالیاتی کشور برای تشویق مؤدیان و حقوق‌بگیران برای پرداخت مالیات در نظر گرفته است. در این مقاله با ارائه یک بازی بین سازمان امور مالیاتی و مؤدیان (و حقوق‌بگیران) به مدل‌سازی و تحلیل نتایج پرداخته شده است. فرض شده است که مالیات دهندگان به طور یکنواخت در بازه [۰، ۱] بخش شده‌اند و توابع مطلوبیت برای بازیکنان تعریف شده است. در نهایت به صورت معکوس و پس از تعیین میزان تبصره ماده ۱۰۰ و استفاده از رابطه بین این دو موضوع، میزان معافیت حقوق و دستمزد (ماده ۸۴) تعیین خواهد گردید. نتایج با توجه به داده‌های فرضی مربوط به سال ۱۴۰۱ نشان داد که میزان معافیت مالیات حقوق تقریباً دو برابر مبلغ اعلامی توسط سازمان امور مالیاتی در سال ۱۴۰۱ است. همچنین در خصوص تبصره ماده ۱۰۰، هر چه مؤدی بی‌تفاوتی در نقاط ابتدایی بازه باشد آنگاه سهم گروه اول کوچک‌تر و سهم گروه سوم بزرگ‌تر خواهد بود و برعکس. با توجه به موقعیت مؤدی بی‌تفاوت که در ابتدای بازه مورد بحث خواهد افتاد، می‌توان نتیجه گرفت که میزان معافیت ارائه شده توسط دولت بسیار کمتر از مقدار واقعی آن است. در نهایت پیشنهاد می‌گردد با توجه به واقع‌گرایی این تحقیق، دولت، مجلس شورای اسلامی و سازمان امور مالیاتی از نتایج این تحقیق که بر پایه متغیرهای مهم و اثرگذار بر موضوعات مورد بررسی است، بهره ببرند. از سوی دیگر مؤدیان مالیاتی نیز در صورت مشخص بودن رویکرد نظام مالیاتی، با این روش می‌توانند به یک قاعده کلی برای هر دوره و سال دست پیدا کرده و انتظارات خود را بر آن منطبق کنند.

کلیدواژه‌ها: نظریه بازی‌ها؛ تعادل نش؛ مدل‌سازی؛ تبصره ماده ۱۰۰؛ ماده ۸۴ ق.م.م.

طبقه بندی JEL: H21, C62, C72

* salahsalimian@yahoo.com

بررسی تأثیر تسهیلات قرض‌الحسنه بر شاخص فلاکت در ایران: یک رویکرد ARDL

مهدی خوش اخلاق* : دانشکده اقتصاد، مرکز آموزش‌های تحصیلات تکمیلی، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران.
مینو امینی میلانی : دانشکده اقتصاد، مرکز آموزش‌های تحصیلات تکمیلی، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران.
اصغر عبدالحسنی هستیانی : دانشکده اقتصاد، مرکز آموزش‌های تحصیلات تکمیلی، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران.

چکیده

افزایش نرخ تورم به همراه نرخ بیکاری (شاخص فلاکت) می‌تواند منجر به هزینه‌های اقتصادی و اجتماعی زیادی شود. از سوی دیگر، با توجه به تأکید دین اسلام بر احیای سنت قرض‌الحسنه و تأثیر این تسهیلات بر متغیرهای کلان اقتصادی، هدف اصلی این مقاله بررسی تأثیر تسهیلات قرض‌الحسنه بر شاخص فلاکت در ایران است و داده‌های سال‌های ۱۳۶۳ تا ۱۴۰۰ مورد استفاده قرار گرفته است. شاخص فلاکت به عنوان یک معیار جامع از رفاه اقتصادی، شامل شاخص‌های تورم و بیکاری است. با استفاده از مدل خودرگرسیون با وقفه توزیع شده (ARDL)، این تحقیق به تحلیل روابط کوتاه‌مدت و بلندمدت بین سهم تسهیلات قرض‌الحسنه و شاخص فلاکت پرداخته است. نتایج نشان می‌دهد که افزایش یک واحد در سهم این تسهیلات منجر به کاهش ۰.۳۱٪ در شاخص فلاکت در کوتاه‌مدت و کاهش ۰.۵۲٪ در بلندمدت می‌شود. همچنین، مدل تصحیح خطا نشان می‌دهد که ۶۰٪ از نوسانات کوتاه‌مدت به سمت تعادل بلندمدت تنظیم می‌شود. این مطالعه همچنین تأثیر منفی هزینه‌های دولتی بر شاخص فلاکت و تأثیر مثبت نرخ ارز واقعی را برجسته می‌کند. بر اساس این نتایج، مقاله توصیه می‌کند که نظارت بر عملکرد بانک‌ها در تخصیص تسهیلات قرض‌الحسنه تقویت شود، هزینه‌های دولتی به سمت پروژه‌های توسعه‌ای هدایت گردد و سیاست‌های ارزی مدیریت شود تا اثرات منفی اقتصادی کاهش یابد. این تحقیق بر اهمیت تسهیلات قرض‌الحسنه به عنوان ابزاری مؤثر برای کاهش فقر و بهبود شرایط اقتصادی در ایران تأکید می‌کند.

کلیدواژه‌ها: قرض‌الحسنه؛ شاخص فلاکت؛ مدل ARDL؛ رفاه اقتصادی؛ هزینه‌های دولتی.

طبقه‌بندی JEL: G40, G39, G19, G00

* me.khoshakhlagh@gmail.com

اثرات اقتصادی و زیست محیطی گذار انرژی در کشور ایران تا افق ۲۰۵۰: الگوی پویای تعادل عمومی قابل محاسبه چند منطقه ای

زین العابدین صادقی* : دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه شهید باهنر، کرمان، ایران.
مصطفی غلامی : دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه شهید باهنر، کرمان، ایران.
سیدعبدالمجید جلائی : دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه شهید باهنر، کرمان، ایران.
مهدی نجاتی : دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه شهید باهنر، کرمان، ایران.

چکیده

کشور ایران برای تامین انرژی به سوخت های فسیلی متکی است و همین امر سبب بروز مشکلاتی در زمینه اقتصاد و محیط زیست شده است به طوری که در سالهای اخیر ناترازی های موجود در زمینه تولید و عرضه انرژی سبب وارد شدن آسیب های جدی به بخش های مختلف اقتصادی شده است. بر همین اساس توجه به ترکیب سبد های انرژی در کشور و اثراتی که فرایند گذار انرژی در کشور خواهد داشت دارای اهمیت فراوان است. از این رو، هدف تحقیق حاضر بررسی اثرات اقتصادی و محیط زیستی گذار انرژی در کشور ایران با شرکای تجاری خود در بخش انرژی می باشد. بدین منظور سه سناریو سه تغییر ترکیب سبد های انرژی در فرآیند گذار انرژی کشور ایران با استفاده از الگوی تعادل عمومی قابل محاسبه چند منطقه ای مورد تحلیل و بررسی قرار گرفته اند. نتایج این پژوهش نشان می دهد که افزایش سهم برق تولید شده از انرژی های تجدید پذیر با فرض ثابت ماندن میزان تولید برق تجدیدناپذیر، هم اثرات مثبت اقتصادی دارد و هم کاهش انتشار کربن را به دنبال خواهد داشت. همچنین اعمال سناریوی افزایش انرژی های تجدیدپذیر با کاهش انرژی تولیدی از سوخت های فسیلی نشان داد که رفاه و تولید ناخالص داخلی به ترتیب ۳/۱۷ و ۲/۳۷ درصد کاهش یافته و همچنین انتشار کربن در این سناریو ۱۰/۸۹ درصد کاهش داشته که نسبت به سناریوهای قبلی کاهش بیشتری داشته است. بنابراین، کاهش تولید انرژی سوخت فسیلی باید با سرعت ملایم تری در مقایسه با افزایش تولید انرژی های تجدیدپذیر اتفاق بیفتد.

کلیدواژه ها: گذار انرژی؛ انرژی های تجدیدپذیر؛ انتشار کربن؛ مدل تعادل عمومی قابل محاسبه.

طبقه بندی JEL: Q56, F18, D58

* z_sadeghi@uk.ac.ir

تحلیل تعامل سهام‌های پیشرو و شوک‌های نرخ ارز با استفاده از تحلیل شبکه و الگوی

VAR-GARCH: شواهدی از بورس اوراق بهادار تهران

مصطفی برات پور : گروه اقتصاد، واحد فیروزکوه، دانشگاه آزاد اسلامی، فیروزکوه، ایران.
 قدرت الله امام وردی * : گروه اقتصاد، واحد تهران مرکزی، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران.
 محمود محمودزاده : گروه اقتصاد، واحد فیروزکوه، دانشگاه آزاد اسلامی، فیروزکوه، ایران.
 پروانه سلاطین : گروه اقتصاد، واحد فیروزکوه، دانشگاه آزاد اسلامی، فیروزکوه، ایران.

چکیده

شناسایی سهام پیشرو برای سرمایه‌گذاران، به ویژه در بازارهایی که فاقد ابزارهای تحلیلی جامع هستند، امری حیاتی است. انتخاب مؤثر سهام مستلزم رویکردی یکپارچه است که تحلیل شبکه مالی، ارزیابی عملکرد و مدل‌سازی پیش‌بینانه را ترکیب می‌کند. این مطالعه به بررسی پیوندهای بین‌شرکتی در بورس اوراق بهادار تهران با تمرکز بر پیامدهای شوک‌های نرخ ارز می‌پردازد. یک چارچوب تحلیلی دو مرحله‌ای به کار گرفته شد: نخست، تحلیل شبکه درخت پوشای کمینه (MST) برای شناسایی سهام پیشرو و اندازه‌گیری تأثیرات نوسانات نرخ ارز استفاده شد. سپس، مدل‌های VAR-GARCH برای تحلیل پویایی‌های نوسان در سهام پیشرو به کار رفتند، در حالی که روش مجموع تجمعی مربعات تکراری (ICSS) برای شناسایی شکست‌های ساختاری در رفتار بازار مورد استفاده قرار گرفت. داده‌ها شامل بازده روزانه ۵۰ سهام برتر و نرخ دلار در بازار آزاد در دوجازه زمانی است: پیش از شوک (۱۳۹۷/۰۱/۱۴ تا ۱۳۹۷/۰۱/۱۵) و پس از شوک (۱۳۹۷/۰۴/۳۱ تا ۱۳۹۹/۰۴/۳۱). در دوره پیش از شوک، شرکت‌های پارس خودرو، فولاد و کگل به‌عنوان سهم‌های رهبر شناسایی شدند. پس از شوک ارزی، بخش‌های صادرات‌محور مانند فلزات به دلیل مزیت رقابتی جایگاه رهبری خود را حفظ کردند، در حالی که صنایع واردات‌محور نظیر خودروسازی با افول قابل توجهی مواجه شدند. در مراحل بعدی، سهام‌هایی مانند وغدیر، فولاد، شاراک و تیپیکو به‌عنوان رهبران جدید ظهور یافتند که بازآرایی ساختاری ناشی از نوسانات ارزی را منعکس می‌کنند. یافته‌ها بر کارایی روش‌های مبتنی بر شبکه در بهینه‌سازی سبد سرمایه‌گذاری و مدیریت ریسک تأکید می‌کنند و وابستگی‌های بخشی و حساسیت به نرخ ارز را در اقتصادهای نوظهور به شکلی تجربی تبیین می‌نمایند.

کلیدواژه‌ها: جهش نرخ ارز؛ سهم‌های رهبر؛ درخت پوشای کمینه (MST)؛ VAR-GARCH

طبقه‌بندی JEL: C32, C14, G11, F31