

ناکارایی تخصیص یا ناکارآمدی اندازه گیری

علی حجتی نجف آبادی : دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه صنعتی شریف، تهران، ایران.
محمد حسین رحمتی* : دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه صنعتی شریف، تهران، ایران.

چکیده

خط وسیعی از ادبیات در زمینه ناکارایی تخصیص، با مرجع قرار دادن روش پژوهش Hsieh و Klenow (۲۰۰۹) و مشابه آن، ریشه‌های افت بهره‌وری کل کشورها را در اعوجاج ناشی از سیاست‌ها برآورد کرده است. در پاسخ، مقالاتی مانند Bill Klenow و Ruane (۲۰۲۰) استدلال کردند که تفاوت‌ها در محصولات میانگین اندازه‌گیری شده ممکن است منعکس کننده خطای اندازه‌گیری به جای تولید حاشیه‌ای باشد. هدف این مقاله صحت سنجی در خصوص تفاوت بهره‌وری کل بین کشورهاست. به این منظور و با مطالعه ادبیات رهیافت محاسبه بهره‌وری کل، این مقاله با مطالعه گشتاورهای بخش تولید در دو کشور هند و چین نشان می‌دهد که افت بهره‌وری کل در کشورها به پارامترهای انباشت عامل و تابع تولید حساس است. فرضیه این پژوهش بر پایه این نظریه بنا شده است که حساسیت پراکندگی بهینه به مولفه‌های تابع تولید و تابع تجمیع بستگی دارد، بنابراین نمی‌توان بدون تدقیق و استفاده از مدل منحصر به هر کشور، در خصوص افت بهره‌وری بر اساس یک نسخه واحد عمل کنیم. نتایج این مقاله نشان می‌دهد که Hsieh و Klenow (۲۰۰۹) به اندازه‌گیری کشش جایگزینی وابسته بوده و سهم سرمایه در تولید، بنابراین، فرض پارامترهای یکسان برای هر سه کشور می‌تواند منجر به اندازه‌گیری اشتباه اثرات واقعی تخصیص نادرست شود. دلالت سیاستی این مقاله بر نیاز به برآورد مناسب پارامترها در هنگام مطالعه تأثیر تخصیص نادرست بر بهره‌وری کل تأکید می‌کند.

کلیدواژه‌ها: افت بهره‌وری کل؛ ناکارایی تخصیص؛ روش شبیه‌سازی گشتاورها.

طبقه‌بندی JEL: E23, E25, C15

* rahmati@sharif.edu.

فرضیه پسماند در بیکاری: شواهدی از بازار نیروی کار ایران

سجاد برخوردار* : دانشکده اقتصاد، دانشگاه تهران، تهران، ایران.

چکیده

هدف این مطالعه، آزمون فرضیه پسماند برای بیکاری جوانان در سطح کلی، منطقه‌ای، روستایی و شهری با استفاده از داده‌های فصلی برای دوره زمانی ۱۳۸۴-۱۳۹۹ است. همچنین در این مقاله، ماهیت تصادفی بیکاری برای سی استان کشور در این دوره بررسی می‌شود. برای این منظور، ابتدا روش‌های ADF و KPS برای آزمون فرضیه پسماند در سطح کلی، روستایی و شهری استفاده کردیم. ثانیاً، روش‌های IPS، Chio و فیشر برای آزمون این فرضیه در سطح منطقه‌ای، به کار گرفتیم. در نهایت، روش PANIC برای شناسایی اجزای عمومی و تصادفی نرخ‌های بیکاری در سطح منطقه‌ای، مورد استفاده قرار گرفت. نتایج بکارگیری روش‌های مختلف از وجود پسماند برای بیکاری جوانان در سطح کلی، روستایی و شهری در ایران حکایت دارد. همچنین یافته‌های تجربی، شواهدی از وجود پسماند در برخی مناطق دارد. این نتایج دلالت بر این دارد که سیاست‌های سمت عرضه برای کاهش بیکاری جوانان در سطوح مختلف، کارا هستند.

کلیدواژه‌ها: بازار نیروی کار؛ بیکاری؛ پسماند؛ روش PANIC.

طبقه‌بندی JEL: J21، J64، C32، C33

* barkhordari@ut.ac.ir

بررسی تاثیر تحریم‌های اقتصادی بر سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در ایران با استفاده از روش کنترل ترکیبی

فرانک میرعالی : دانشکده علوم اقتصادی و اجتماعی، دانشگاه بوعلی سینا، همدان، ایران.
سعید عیسی زاده* : دانشکده علوم اقتصادی و اجتماعی، دانشگاه بوعلی سینا، همدان، ایران.
سید احسان حسینی دوست : دانشکده علوم اقتصادی و اجتماعی، دانشگاه بوعلی سینا، همدان، ایران.

چکیده

سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی (FDI) به عنوان بخش جدایی‌ناپذیر از یک نظام اقتصادی باز و موثر بین المللی و عاملی کلیدی برای رشد و توسعه بین کشورها محسوب می‌شود. ایران به دلیل برخورداری از منابع عظیم نفت و گاز و همچنین بازارهای نسبتاً بزرگ، پتانسیل بالایی برای جذب سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به مراتب بیشتر از عملکرد خود دارد. این در حالی است که اعمال تحریم‌های مختلف بر کشور در سال‌های اخیر با ایجاد فضای روانی خصمانه و ریسک بالای فعالیتهای اقتصادی منجر به کاهش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی شده است. در این مقاله قصد داریم با استفاده از روش کنترل ترکیبی (SCM) به بررسی تاثیرات گسترده تحریم‌های اقتصادی اعمال شده توسط ایالات متحده بر FDI ایران بین سال‌های ۱۹۸۰ تا ۲۰۲۰ بپردازیم. ما از طریق SCM تفاوت FDI را بین کشور تحت درمان (ایران) و ترکیبی (ایران ترکیبی) تخمین می‌زنیم. نتایج نشان می‌دهد که تحریم‌ها منجر به کاهش تقریباً ۱۲ میلیارد دلاری سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در مقایسه با وضعیت بدون تحریم شده است. به دنبال تشدید تحریم‌ها در دولت ترامپ و خروج ایالات متحده از برجام، اثرات منفی کاهش FDI به اوج خود یعنی ۲۰ میلیارد دلار در سال ۲۰۲۰ رسیده است. علاوه بر این، آزمون‌های دارونما نشان می‌دهند که نتایج از نظر آماری در سطح ۱۰٪ معنادار هستند.

کلیدواژه‌ها: تحریم‌های اقتصادی؛ سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی؛ روش کنترل ترکیبی؛ استخر اهداکننده.

طبقه‌بندی JEL: C21, F21, F51

* s.eisazadeh@basu.ac.ir

تحلیل آثار مشوق‌های مالیاتی در چارچوب تعادل عمومی و جزئی: مطالعه موردی اقتصاد ایران

ابراهیم رضائی* : موسسه تحقیق و توسعه علوم انسانی (سمت)، تهران، ایران.

چکیده

بررسی ادبیات تحقیق در یک دهه اخیر نشان می‌دهد که کشورهای توسعه یافته اغلب از مشوق‌های مالیاتی به عنوان یک ابزار مالی موقت جهت تحریک اقتصاد خود بعد از بحران مالی ۲۰۰۷-۲۰۰۸ میلادی استفاده کرده‌اند در حالی که کشورهای در حال توسعه از این ابزار به طور گسترده‌ای به عنوان یک سیاست عادی و دائمی جهت به حرکت درآوردن اقتصاد خود استفاده می‌کنند. در بین کشورهای گروه دوم، مقامات مالی در ایران از دامنه وسیعی از انواع مشوهای مالیاتی برای تحریک متغیرهای بخش واقعی اقتصاد مانند سرمایه‌گذاری، انباشت سرمایه و تولید در بلندمدت بهره می‌گیرند. روش‌شناسی تحقیق حاضر برمبنای شبیه‌سازی یک مدل تعادل عمومی و جزئی استوار است. در این مطالعه، با بهره‌گیری از یک مدل تعادل عمومی کینزینی جدید، آثار مشوق‌هایی مانند تخفیف‌های مالیاتی، استهلاک شتابان و کاهش نرخ مالیات بر متغیرهای کلان اقتصادی (سرمایه‌گذاری، موجودی سرمایه، تولید و مصرف) و نیز بر متغیرهای بودجه دولت (درآمدهای دولت و ارزش فعلی درآمدهای دولت) مورد بررسی قرار گرفته‌اند. نتایج بدست آمده نشان می‌دهند که تحت فرض انعطاف‌پذیری کامل قیمت‌ها و دستمزدها، اجرای سیاست اعمال مشوق‌های مالیاتی باعث افزایش قابل توجه کسری بودجه و بدنبال خود ناپایداری وضعیت مالی دولت خواهد شد. با این حال، تحمیل چسبندگی‌های اسمی باعث بروز آثار مثبت مشوق‌های مالیاتی و بهبود نسبی پایداری بودجه‌ای دولت می‌شود. به عبارت دیگر، چسبندگی قیمت‌ها و دستمزدها باعث واکنش مثبت متغیرهای واقعی اقتصاد به مشوق‌های مالیاتی می‌شود.

کلیدواژه‌ها: تعادل عمومی و جزئی؛ مشوق‌های مالیاتی؛ ایران؛ مدل تعادل عمومی کینزینی‌های جدید.

طبقه‌بندی JEL: E10, E17, E22, H21, H25

* rezaee@samt.ac.ir , Ebrahim.rezaei@gmail.com

شناسه دیجیتال DOI: 10.22099/ijes.2022.43386.1823

تاریخ بازنگری: ۲۳ شهریور ۱۴۰۱

تاریخ دریافت: ۷ فروردین ۱۴۰۱

تاریخ انتشار برخط: ۱ اسفند ۱۴۰۲

تاریخ پذیرش: ۴ آبان ۱۴۰۱

کووید-۱۹ و نرخ تورم: مطالعه کشورهای سازمان همکاری و توسعه اقتصادی (OECD)

رامین امانی : دانشکده علوم انسانی و اجتماعی، دانشگاه کردستان، سنندج، ایران.
سامان قادری* : دانشکده علوم انسانی و اجتماعی، دانشگاه کردستان، سنندج، ایران.
خالد احمدزاده : دانشکده علوم انسانی و اجتماعی، دانشگاه کردستان، سنندج، ایران.

چکیده

کووید-۱۹ از سال ۲۰۱۹ بر اقتصاد جهان تأثیر گذاشته است. همه‌گیری ویروس کرونا یکی از جدی‌ترین و خطرناک‌ترین معضلاتی است که بشریت در قرن اخیر با آن مواجه بوده است؛ بنابراین، هدف این مقاله بررسی تأثیر کووید-۱۹ بر نرخ تورم در ۳۶ کشور عضو OECD است. برای دستیابی به این هدف از داده‌های ماهانه کووید-۱۹ و نرخ تورم از فوریه ۲۰۱۹ تا آگوست ۲۰۲۱ و روش رگرسیون پانل چندکی استفاده شده است. نتایج نشان می‌دهد که موارد جدید کووید-۱۹ باعث کاهش نرخ تورم در همه چندک‌ها می‌شود که به این معنی است که با افزایش تعداد موارد کووید-۱۹، فعالیت‌های اقتصادی به دلیل محدودیت‌های تجاری کاهش می‌یابد. علاوه بر این، مرگ‌ومیرهای جدید کووید-۱۹ تأثیر دوگانه‌ای بر نرخ تورم در کشورهای OECD دارد. با افزایش آمار مرگ‌ومیر ناشی از کووید-۱۹، محدودیت‌های کسب‌وکار افزایش یافته و اقتصاد وارد رکود شده و تورم کاهش یافته است. از سوی دیگر، رشد تلفات کووید-۱۹ می‌تواند نااطمینانی اقتصادی و تورم را افزایش دهد. علاوه بر این، واکنش‌های کووید-۱۹ اثرات مثبت و قابل‌توجهی بر نرخ تورم در کشورهای OECD دارد. براین اساس، به سیاست‌گذاران توصیه می‌شود برای افزایش فعالیت‌های اقتصادی و افزایش رونق در اقتصاد این کشورها، افزایش تزریق واکسن به‌ویژه دوزهای تقویت‌کننده را در نظر بگیرند. از طرف دیگر، کووید-۱۹ ضرورت آمادگی جهان در برابر بیماری‌های واکسیناسیون را آینده را نشان داد.

کلیدواژه‌ها: کووید-۱۹؛ نرخ تورم؛ کشورهای OECD؛ رگرسیون چندکی.

طبقه‌بندی JEL: C22, E31, I1

* s.ghaderi@uok.ac.ir

شواهدی جدید از اثر درآمدهای نفتی، نرخ ارز و حجم نقدینگی بر PPI و CPI : رهیافت $ARDL$ مبتنی بر چندک

روزبه بالونزادنوری : گروه اقتصاد، پژوهشکده امور اقتصادی، تهران، ایران.
امیرعلی فرهنگ* : گروه اقتصاد، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران.

چکیده

رابطه بین درآمد نفتی، نرخ ارز و $M2$ بر شاخص‌های قیمت مصرف‌کننده و شاخص مصرف‌کننده، طی سال‌های ۱:۲۰۰۵-۱:۲۰۲۲، در ایران با استفاده از روش $QARDL$ بررسی شد. نتایج نشان داد که در کوتاه‌مدت تمامی متغیرها تأثیر نامتقارن بر PPI و CPI داشتند. درآمدهای نفتی در بلندمدت از چندک ۵/ تا میانه، تأثیر متغیر بر تورم افزایش یافته و سپس تأثیر آن کاهش می‌یابد. همچنین در بلندمدت اثر افزایش بر PPI بیشتر از شاخص قیمت مصرف‌کننده است. در بلندمدت، اثر نرخ ارز بر شاخص‌های قیمت مصرف‌کننده و PPI ، در عین متقارن بودن، غیرخطی بود. زیرا از چندک ۰.۲ تا ۰.۸ اثر آن به نسبت افزایش و سپس کاهش یافت. همچنین در مورد $M2$ ، نتایج نشان داد که این متغیر بر PPI و CPI در کوتاه مدت اثر نامتقارن دارد. به این ترتیب که از چندک میانی تا چندک ۹/، اثر آن مثبت و معنادار بود و در بلندمدت نیز نتایج حاکی از تأثیر مثبت آن بر تورم در تمامی چندک‌ها بود. اگرچه، اثر آن بر PPI نامتقارن بود.

کلیدواژه‌ها: قیمت نفت؛ نرخ ارز؛ CPI ؛ PPI ؛ $QARDL$.
طبقه‌بندی JEL : B23، C22، E44

* s_farhang@pnu.ac.ir

تدوین مدل جامع ارزیابی عملکرد بازاریابی در سطح شعب در نظام بانکی ایران با استفاده

از رویکرد نظریه زمینه‌ای

- صالح صدیقی شیراز : گروه مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی تبریز، تبریز، ایران.
صمدعالی* : گروه مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی تبریز، تبریز، ایران.
رسول وظیفه : گروه مدیریت، واحد پارس آبادمغان، دانشگاه آزاد اسلامی، پارس آبادمغان، ایران.
علیرضا بافنده زنده : گروه مدیریت، دانشگاه آزاد اسلامی تبریز، تبریز، ایران.

چکیده

امروزه مسأله اساسی سازمان‌هایی که دارای شعب فراوان هستند بخصوص بانک‌ها ارزیابی صحیح و منطقی است. شاخص‌های خوب ارزیابی می‌تواند به هدایت بهتر بخش‌ها و نیروها کمک شایانی داشته باشد. وجود و به‌کارگیری الگوی مناسب برای ارزیابی عملکرد بازاریابی شعب، می‌تواند به پاسخگویی، ارتقای کیفیت خدمات، افزایش رضایت و وفاداری مشتری و در نهایت سودآوری هرچه بیشتر بانک بیانجامد. بر همین اساس هدف این تحقیق طراحی و تبیین الگوی جامع ارزیابی عملکرد بازاریابی شعب بانک‌ها با رویکرد کیفی و استفاده از روش گردن‌دثتوری می‌باشد. با توجه به اشیاع نظری بیست نفر با نمونه‌گیری قضاوتی انتخاب و داده‌ها به روش مصاحبه نیمه‌ساختاریافته جمع‌آوری شده و از فرایند سه‌مرحله‌ای کدگذاری باز، محوری و انتخابی جهت تجزیه و تحلیل داده‌ها استفاده شده است. یافته‌های پژوهش بیان می‌کند شعب بانک شامل کارکنان و مدیریت، خدمات بانکی در سطحی از کیفیت را ارائه می‌دهند، به مرور زمان عملکرد بازاریابی شعب متبلور می‌شود. فرهنگ سازمانی در کنار بازار محلی و عوامل اقتصاد کلان، قوانین و تکالیف فراشعبه‌ای و نوسانات شدید بازار محلی در مدیریت ارتباط با مشتری، مدیریت سرمایه انسانی و بهسازی مستمر بروز پیدا می‌کند و پیامد این مدیریت، به‌دست آوردن وفاداری مشتری، تولید برندی موفق و سودآوری است.

کلیدواژه‌ها: عملکرد بازاریابی؛ شعب بانک؛ نظریه مبنایی؛ ارزیابی عملکرد.

طبقه‌بندی JEL: G24, M10, M19, M31

* samad.aali@iaut.ac.ir

رابطه بین صندوق قابل معامله در بورس (ETF) و شکنندگی بازار: شواهدی از بازار سهام ایران

علی اکبر جعفری زاده مالگیری : گروه مهندسی مالی، واحد یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران.
 غلامرضا عسکرزاده* : گروه مهندسی مالی، واحد یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران.
 حمید خواجه محمود آبادی : گروه مهندسی مالی، واحد یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران.
 یحیی ابطجی : گروه مهندسی مالی، واحد یزد، دانشگاه آزاد اسلامی، یزد، ایران.

چکیده

هدف این پژوهش بررسی اثربخشی صندوق های ETF بر بازار سهام ایران است. شاخص مورد بررسی در این تحقیق میزان شکنندگی بازار سهام در ایران است. برای این منظور در ابتدا از مدلی استفاده شده است که نشان می دهد ورود یک صندوق ETF در بازار چقدر می تواند بر ثبات و شکنندگی بورس تاثیر بگذارد. سپس به منظور تحلیل موضوع، مجموعه ای از صندوق های ETF در ایران انتخاب شده است. با استفاده از تحلیل رگرسیون، نتایج و تحلیل ها الگویی را به دست می دهند که با ورود وجوه ETF، ارزش غیرسیستماتیک مقادیر افزایش یافته است. بنابراین نتیجه می گیریم که ورود صندوق های ETF به بازار، شکنندگی در بورس ایران را افزایش می دهد.

کلیدواژه‌ها: صندوق های ETF؛ شکنندگی بازار؛ بازار سهام؛ دارایی های ETF .

طبقه بندی JEL : G12, G17, G31, G32

* askarzadeh1360@yahoo.com

بررسی آثار و پیامدهای تغییر در اجزای بودجه دولت بر متغیرهای کلان اقتصادی

ناصر الفتی : گروه آموزشی اقتصاد و حسابداری، دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه لرستان، لرستان، ایران.
محبوبه دلفان* : گروه آموزشی اقتصاد و حسابداری، دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه لرستان، لرستان، ایران.
محمد علیزاده : گروه آموزشی اقتصاد و حسابداری، دانشکده مدیریت و اقتصاد، دانشگاه لرستان، لرستان، ایران.
سهراب دل‌انگیزان : گروه اقتصاد، دانشکده علوم اجتماعی، دانشگاه رازی، کرمانشاه، ایران.

چکیده

هدف از این مطالعه بررسی آثار و پیامدهای ابزارهای سیاست مالی بر متغیرهای کلان اقتصادی، با توجه به نحوه مصرف آن‌ها می‌باشد. به منظور فراهم نمودن یک تحلیل جامع از آثار مذکور، یک الگوی تعادل عمومی پویای تصادفی باز با لحاظ بخش‌های خانوار، بنگاه، دولت و بانک مرکزی و متناسب با ویژگی‌های اقتصاد ایران طراحی شده است که در آن خانوارها در قالب دو دسته ریکاردویی و غیرریکاردویی در نظر گرفته شده است. در بخش مالی، مخارج دولت به سه قسمت مخارج کالاهای مطلوب، کالاهای عمومی و مخارج عمرانی تقسیم شده است و همچنین درآمدهای مالیاتی دولت به عنوان ابزار سیاست‌گذار مالی به سه دسته نرخ مالیات بر مصرف، نرخ مالیات بر دستمزد و نرخ مالیات بر سرمایه تقسیم شده است. پارامترهای ساختاری مدل با استفاده از داده‌های فصلی دوره ۱۳۹۹ - ۱۳۸۳ برآورد شده است. نتایج حاصل از شبیه‌سازی مدل نشان می‌دهد که افزایش یک نرخ مالیاتی به منظور تامین مالی مخارج دولت بستگی به ماهیت هزینه دولت (جاری یا عمرانی) و هدف سیاست‌گذار دارد به نحوی که اگر هدف تامین مخارج جاری باشد و دولت مایل به کاهش سطح مصرف و تولید نباشد آنگاه لازم است نرخ مالیات بر سرمایه را افزایش دهد و اگر هدف تامین مخارج عمرانی بوده و دولت مایل به کاهش سطح سرمایه ثابت و مخارج سرمایه‌گذاری نباشد، آنگاه لازم است نرخ مالیات بر مصرف یا نرخ مالیات بر دستمزد را افزایش دهد.

کلیدواژه‌ها: سیاست مالی؛ مخارج دولت؛ بودجه دولت؛ مخارج سرمایه‌گذاری دولت.

طبقه بندی JEL: H25, H31, H32, H53, H68

* Delfan.m@lu.ac.ir

اثر شوک عرضه نفت بر اقتصاد جهانی: دو غول نفتی اوپک

الهام غلامپور* : دانشکده اقتصاد، دانشگاه پیام‌نور، تهران، ایران.
 تیمور محمدی : دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران.
 اصغر ابوالحسنی هستیانی : دانشکده اقتصاد، دانشگاه پیام‌نور، تهران، ایران.
 محسن مهرآرا : دانشکده اقتصاد، دانشگاه تهران، تهران، ایران.

چکیده

این مطالعه یک مدل GVAR-Oil را برای ۲۷ کشور و منطقه طی دوره زمانی ۱۹۷۹:۲-۲۰۱۹:۴ برآورد می‌کند. بر اساس آن می‌توان پیامدهای اقتصاد کلان مربوط به شوک‌های عرضه نفتی یک کشور را در سطح جهانی بررسی کرد. این مدل کمک می‌کند که نه تنها تاثیر شوک‌ها بر کشورهای که مستقیماً در معرض آن قرار دارند اندازه‌گیری شود؛ بلکه با لحاظ کانال‌های ارتباطی میان کشورها آثار غیرمستقیم شوک‌ها نیز قابل ارزیابی خواهد بود. بر اساس این مدل، تحلیل جداگانه شوک‌های عرضه نفت دو کشور مهم عضو اوپک یعنی عربستان سعودی و ایران آسان‌تر خواهد بود و واکنش کشورها بسته به این شوک‌ها می‌تواند متفاوت باشد. یافته‌های پژوهش نشان داد که شوک منفی به عرضه نفت ایران در مقایسه با همین شوک برای عربستان تاثیر بسیار کمی بر اقتصاد جهان دارد، زیرا این شوک منفی با افزایش عرضه نفت عربستان جبران می‌شود. اما شوک منفی به عرضه نفت عربستان عرضه منجر به افزایش قیمت نفت می‌شود و آثار منفی نسبتاً بزرگی بر اقتصاد و بازارهای مالی جهانی دارد. روش GVAR-Oil به تصمیم‌گیرندگان این امکان را می‌دهد که به طور دقیق‌تری آثار کووید-۱۹، تحریم‌ها و تقابل کشورها با یکدیگر را بررسی و استراتژی‌های بهتری انتخاب کنند.

کلیدواژه‌ها: اقتصاد جهانی؛ بازار مالی؛ خودتوضیحی برداری جهانی؛ ایران؛ عربستان؛ شوک عرضه نفت.

طبقه‌بندی JEL: Q43, D43, C32

* elham_gh44@yahoo.com

شناسه دیجیتال DOI: 10.22099/ijes.2023.43619.1838

تاریخ بازنگری: ۲۶ آذر ۱۴۰۱

تاریخ دریافت: ۵ خرداد ۱۴۰۱

تاریخ انتشار برخط: ۲۹ اسفند ۱۴۰۲

تاریخ پذیرش: ۱۸ دی ۱۴۰۱

بررسی تأثیر تحریم‌های اقتصادی بر ناترازی نرخ ارز در ایران

مهدی همتی : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
ابراهیم هادیان* : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
علی حسین صمدی : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
احمد صدرایی جواهری : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.

چکیده

انحراف نرخ ارز بسیاری از کشورهای جهان را درگیر کرده است و بخش داخلی و خارجی اقتصاد را عمیقاً تحت تأثیر قرار داده است؛ از این رو شناسایی علل پیدایش و شکل‌گیری ناترازی نرخ ارز امری ضروری است. مطالعات انجام‌شده بر روی اقتصاد ایران، عمدتاً تأثیر تحریم‌ها را بر متغیرهای کلان اقتصادی شامل رشد اقتصادی، تولید داخلی، نقدینگی، صادرات، واردات، قیمت نفت، درآمدهای نفتی و غیره مورد ارزیابی قرار داده است. اما پژوهشی در زمینه ارزیابی تأثیر تحریم‌ها بر انحراف نرخ ارز موثر حقیقی در ایران وجود ندارد.

هدف اصلی این مقاله برآورد تأثیر تحریم‌های اقتصادی بر انحراف نرخ ارز مؤثر حقیقی (REER) در چارچوب اقتصاد ایران در دوره زمانی ۱۹۹۶:۱-۲۰۱۹:۴ است. در این راستا ابتدا مدل طراحی شده توسط ادواردز (۱۹۸۹) و کوتانی و همکاران (۱۹۸۹) و با استفاده از رگرسیون انتقال ملایم لجستیک برای برآورد نرخ ارز مؤثر حقیقی تعادلی و انحراف آن، بکار گرفته شده است. همچنین از تحلیل عاملی برای برآورد شاخص‌های تحریم اقتصادی استفاده شده است. سپس برای تجزیه و تحلیل تأثیر تحریم‌های اقتصادی بر ناترازی نرخ ارز مؤثر حقیقی از یک الگوی خود رگرسیونی با وقفه‌های توزیع شده غیرخطی (NARDL) استفاده شده است. مسیر زمانی ناترازی برآورد شده نشان‌دهنده نوسانات زیادی در طول دوره مورد مطالعه است. همچنین نتایج برآورد شده نشان می‌دهد که تحریم‌ها بر این ناترازی در کوتاه‌مدت و بلندمدت تأثیر معناداری دارد و در نتیجه عدم تعادل اقتصادی ایران را افزایش می‌دهد.

کلیدواژه‌ها: ناترازی نرخ ارز حقیقی؛ تحریم‌های اقتصادی؛ اقتصاد ایران.

طبقه‌بندی JEL: B22, B22, C22, F31, F51

* ehadian@rose.shirazu.ac.ir

یکپارچگی تجاری با رویکرد تنوع‌سازی مالی: ایران و شرکای تجاری (کشورهای عضو اکو، D8 و اوراسیا)

زهرا عقیلی* : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
 رضا اکبریان : دانشکده اقتصاد، دانشگاه خوارزمی، تهران، ایران.
 احمد صدرایی جواهری : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
 پرویز رستم زاده : بخش اقتصاد، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.

چکیده

باتوجه به اهمیت بخش مالی و ارتباط این بخش با بخش‌های دیگر از جمله بخش تجارت خارجی، در سال‌های اخیر ضرورت بررسی نقش توسعه مالی بر تجارت و یکپارچگی تجاری مورد توجه پژوهش‌گران و برنامه‌ریزان این بخش قرار گرفته است. بنابراین در پژوهش حاضر با استفاده از داده‌های ۱۲ کشور منتخب عضو سازمان همکاری‌های اقتصادی (اکو)، اوراسیا و D8 طی دوره زمانی ۲۰۲۰-۱۹۹۶ و با استفاده از مدل الگوی جاذبه تعمیم‌یافته، به شناسایی تأثیر تنوع ابزارهای مالی مانند آزادسازی مالی و عملیات بازار باز به عنوان توسعه مالی بر ایجاد یکپارچگی تجاری بین ایران و کشورهای منتخب مذکور پرداخته شد. نتایج حاکی از تأثیر مثبت و معنادار شاخص آزاد سازی مالی بر درجه یکپارچگی تجاری کشورهای مورد مطالعه دارد. همچنین کشش یکپارچگی تجاری نسبت به شاخص عملیات بازار باز مثبت ۰/۰۱ می‌باشد. اندازه اقتصادی، از دیگر متغیرهای مستقلی است که دارای تأثیر مثبت بر درجه یکپارچگی تجاری می‌باشد. همگرایی درآمدی، جمعیت، نرخ ارز واقعی و فاصله جغرافیایی دارای اثرات منفی و معناداری بر یکپارچگی تجاری بین کشورهای مورد مطالعه هستند. نتایج حاصل از این پژوهش می‌تواند در جهت تعیین راهبردهای توسعه بخش‌های تجارت و مالی مورد توجه سیاست‌گذاران و برنامه‌ریزان کشورها در اتحادیه‌های اکو، اوراسیا، D8 و بالاخص ایران قرار گیرد. زیرا ایجاد و گسترش و تقویت ترتیبات منطقه‌ای می‌تواند زمینه ساز ورود کشورهای منطقه به اقتصاد جهانی را فراهم نموده و آن‌ها را در مقابل مشکلات جهانی شدن حفظ نماید.

کلیدواژه‌ها: یکپارچگی تجاری؛ تنوع‌سازی مالی؛ آزادسازی مالی؛ عملیات بازار باز؛ مدل‌های پانل دیتا.
 طبقه‌بندی JEL: C33, F15, G19

* z.aghili80@gmail.com