

انتخاب پویای سبد سهام از طریق یک فرآیند ایتو با ساختارمندی اطلاعاتی بیشتر

محمد فقهی کاشانی : دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران.
احمدرضا محبی مجد* : دانشکده اقتصاد، دانشگاه علامه طباطبائی، تهران، ایران.

چکیده

اگرچه نظریه‌های مربوط به انتخاب سبد سهام تاکنون پیشرفت قابل توجهی داشته‌اند، عملکرد پرتفوی پیشنهادی آن‌ها تا حد زیادی به میزان دقت در پیش‌بینی پویایی قیمت سهام در آینده بستگی دارد. این مطالعه بر بهبود عملکرد پرتفوی بهینه با مدل‌سازی پویایی قیمت سهام از طریق یک فرآیند انتشار چند متغیره ناسازگار با زمان با بردار رانش تمرکز دارد. برای این منظور، قیمت سهام با استفاده از یک فرآیند شبه مارتینگل با مارتینگل زمان ناسازگار (محلی) و بخش‌های رانش اطلاعات در کل افق بهینه‌سازی شبیه‌سازی می‌شوند. سپس با استفاده از نتایج شبیه‌سازی قیمت، پیامدهای آن را برای ساخت سبد دارایی‌ها در چارچوب روش بهینه‌سازی نسبت شارپ و تحلیل میانگین - واریانس بررسی کرده‌ایم. یافته‌ها حاکی از آن است که برای بازار سهام مورد مطالعه (تهران) در بازه زمانی فروردین ۱۳۸۰ تا شهریور ۱۳۹۹، پرتفوی‌های حاصل از اعمال این شبیه‌سازی برای هر دو روش میانگین - واریانس و بهینه‌سازی نسبت شارپ دارای بازده بالاتر و ریسک (انحراف معیار) کمتر از روش‌های متداول هستند. علاوه بر این، مقایسه رویکرد شبیه‌سازی با عملکرد پرتفوی‌های واقعی بازار نشان می‌دهد که نسبت‌های شارپ روش شبیه‌سازی بالاتر از نسبت‌های حاصل از پرتفوی‌های بازار است.

کلیدواژه‌ها: سبد سهام؛ حرکت براونی هندسی چند-بعدی؛ نسبت شارپ؛ میانگین-واریانس.
طبقه‌بندی JEL: G11, G17, C61, C63

* A.Mohebi-Majd@lse.ac.uk

بازدهی بورس سهام ایران در سه موج همه‌گیری کووید-۱۹: شواهدی از رگرسیون با شکست‌های چندگانه

علی چشمی* : گروه اقتصاد، دانشگاه فردوسی مشهد، مشهد، ایران.
 فریبا عثمانی : گروه اقتصاد، دانشگاه فردوسی مشهد، مشهد، ایران.

چکیده

با وجود رکود در بازارهای مالی جهانی، بورس تهران در دوران شیوع کووید-۱۹ رشد قابل توجهی را تجربه کرد. بنابراین، این مقاله با تحلیل تأثیر سه موج کرونا بر شاخص کل بورس اوراق بهادار تهران، زیرشاخص‌های آن و صنایع مختلف با داده‌های روزانه ایران و روش رگرسیون با شکست‌های چندگانه، سعی در حل این معما دارد. نتایج نشان می‌دهد که هر موج کووید-۱۹ تأثیر متفاوتی بر بازار سهام دارد. کووید ۱۹ در موج اول بر شاخص صناعی مانند پالایش نفت، شیمیایی، فلزات و حمل و نقل تأثیر منفی داشت اما بر صنایعی مانند دارو و غذا تأثیر مثبت داشت. اما در امواج بعدی، واکنش صنایع مختلف به این همه‌گیری به دو دلیل پیچیده است. یکی اینکه نرخ اسمی ارز بر صنایع اصلی مانند خودرو، بانک، پالایش نفت، فلزات و پتروشیمی (که وزن قابل توجهی در بورس تهران دارند) اثر مثبت و معناداری دارد، که می‌تواند روند مثبت شاخص به ویژه در موج اول و دوم کووید-۱۹ را نشان دهد. دو، دستکاری دولت در افزایش قیمت سهام این صنایع اصلی به منظور تامین مالی کسری بودجه خود باعث شد تا شاخص بورس تهران در برخی دوره‌ها در واکنش به ویروس کرونا در جهت مخالف حرکت کند.

کلیدواژه‌ها: بازار سهام؛ بورس اوراق بهادار تهران؛ کووید -۱۹؛ ویروس کرونا؛ رگرسیون شکست‌های چندگانه.
 طبقه‌بندی JEL: C34, G10, G12, G24

* a.cheshomi@um.ac.ir

تأثیر استرس مالی بر بازارهای طلا، ارز و سهام در ایران: رویکرد علیت گرنجری متغیر طی زمان

علی رضازاده*
رقیه محسنی نیا

: گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.
: گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد و مدیریت، دانشگاه ارومیه، ارومیه، ایران.

چکیده

این مطالعه با ارائه دیدگاهی جامع و متفاوت در ادبیات نظری رابطه بین شاخص استرس مالی و بازارهای مالی و با ارائه روشی نوین به بررسی رابطه غیرخطی بین شاخص استرس مالی و بازارهای مالی برای نظام مالی ایران پرداخته است. برای این منظور، از آزمون‌های علیت گرنجر با زمان متغیر استفاده شد. پس از محاسبه شاخص استرس مالی، رابطه علی بین این متغیر و متغیرهای قیمت طلا، نرخ ارز و نیز شاخص قیمت سهام طی دوره زمانی سپتامبر ۲۰۰۵ تا دسامبر ۲۰۱۹ با به کارگیری آزمون‌های علیت متغیر طی زمان و تخمین زنده‌های rolling, forward و recursive ارزیابی و برآورد شده است. همچنین، در جهت تحلیل حساسیت، همه تخمین‌ها با لحاظ وجود ناهمسانی واریانس در سری‌های زمانی مجدداً انجام یافت. با توجه به ماهانه بودن داده‌های مورد استفاده و احتمال بالای وجود ناهمسانی واریانس، نتایج حاصل از تخمین‌ها با لحاظ ناهمسانی واریانس دارای اعتبار بیشتری هستند. نتایج برآورد با لحاظ ناهمسانی واریانس و آزمون علیت متغیر طی زمان در بررسی رابطه بین استرس مالی و بازار سهام هیچ شواهدی مبنی بر علیت بین استرس مالی و شاخص قیمت سهام با استفاده از الگوریتم‌های forward و rolling نشان نداد. بر اساس نتایج حاصل از تخمین مدل‌ها می‌توان استدلال کرد که شاخص استرس مالی، علت نوسانات بازار طلا در ایران بوده ولی علیت گرنجری بازارهای ارز و سهام نیست.

کلیدواژه‌ها: سهام، طلا؛ ارز، شاخص استرس مالی؛ آزمون‌های علیت گرنجری متغیر طی زمان.

طبقه‌بندی JEL: G13، G10، E44

* a.rezazadeh@urmia.ac.ir

اصلاح یارانه ها و کارایی تولید گاوداری‌های شیری در ایران

زینب شکوهی* : دانشکده کشاورزی، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
 محمد بخشوده : دانشکده کشاورزی، دانشگاه شیراز، شیراز، ایران.
 مهدی عسگری : دانشکده کشاورزی، دانشگاه کنتاکی، لگزینگتون، آمریکا.

چکیده

اصلاح یارانه‌ها در ایران از سال ۱۳۸۹ پس از اجرای طرح هدفمندی یارانه‌ها، آغاز شد. افزایش کارایی و بهره‌وری واحدهای تولیدی به واسطه واقعی شدن قیمت‌ها هدف اصلی این سیاست بود. با وجود افزایش قیمت نهاده‌ها و محصول دستیابی به اهداف سیاست که مهمترین آن افزایش کارایی در واحدهای تولیدی است، مسئله اصلی است. در این راستا هدف اصلی این مقاله مقایسه کارایی گاوداری‌های شیری ایران قبل و بعد از اجرای طرح هدفمندی یارانه‌ها در نظر گرفته شد. برای این منظور از داده‌های موجود برای گاودارهای شیری در ۱۸ استان در سال‌های ۱۳۶۹، ۱۳۷۲، ۱۳۷۹، ۱۳۸۶، ۱۳۹۲، ۱۳۹۵ و ۱۳۹۸ استفاده شد و با تحمیل شرط یکنواختی در ارزیابی کارایی، از تحلیل مرزی تصادفی استفاده شد. نتایج نشان می‌دهد که تابع تولید مرزی نامقید در انرژی و نیروی کار یکنواخت نیست. بنابراین، تحمیل شرط یکنواختی، اربب برآورد را جهت سیاست‌گذاری مناسب کاهش می‌دهد. تخمین ناریب کارایی تولید ناشی از اعمال شرط یکنواختی بسته به منطقه از ۰/۷۲ تا ۰/۸۶ متغیر است. همچنین نتایج حاکی از کاهش ۱۷ درصدی کارایی تولید در گاوداری‌های شیری مورد بررسی پس از اجرای طرح اصلاح یارانه‌ها است که برخلاف اهداف سیاستی طرح مذکور است. تفاوت‌های منطقه‌ای در کارایی تولید گاوداری‌های شیری نشان می‌دهد که اعمال سیاست‌های تکمیلی در سطح استان، می‌تواند با انتقال تجربیات از مناطق کارا تر به سایر مناطق در جهت بهبود کارایی تولید اثربخش باشد.

کلیدواژه‌ها: کارایی؛ یکنواختی؛ تولید مرزی؛ طرح هدفمندی یارانه‌ها؛ ایران.

طبقه‌بندی JEL: C11، Q54، D24

* z_shokoohi@shirazu.ac.ir

پیمادهای اقتصادی - زیست‌محیطی اصلاح یارانه‌های سوخت فسیلی با استفاده از مدل RICE در کشورهای منطقه‌ی خاورمیانه و شمال آفریقا تا افق زمانی ۲۱۰۰

مرضیه حق شناس : گروه اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران.
رزیتا مویدفر* : گروه اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران.
شکوفه فرهمند : گروه اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران.
علیمراد شریفی : گروه اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران.

چکیده

دمای زمین در طول ۱۰۰ سال گذشته ۰,۷ درجه سانتیگراد (درجه سانتیگراد) افزایش یافته است و انتظار می‌رود میانگین دمای جهانی تا سال ۲۱۰۰ بین ۱,۸ تا ۶,۴ درجه سانتیگراد افزایش یابد. مجمع بین‌دولتی تغییرات آب و هوا (IPCC) پیش‌بینی می‌کند که تغییرات آب و هوا به ویژه افزایش دما باعث ایجاد چالش‌هایی برای منطقه‌ی منا در طول قرن ۲۱ خواهد شد.

در نتیجه، هدف این مطالعه ارزیابی تأثیر سیاست‌های حذف یا اصلاح یارانه‌های سوخت‌های فسیلی به منظور کاهش گرمایش جهانی، و همچنین تأثیر اجرای این سیاست‌ها بر متغیرهای اقتصادی (تولید ناخالص داخلی، مصرف، انباشت سرمایه، اشتغال و اثرات زیست‌محیطی) در منطقه‌ی منا تا افق زمانی (۲۱۰۰) می‌باشد. برای این منظور از مدل یکپارچه‌ی پویای منطقه‌ای آب و هوایی و اقتصادی (RICE)؛ استفاده شده است. نتایج پژوهش حاکی از آن است که در بلندمدت (تا پایان قرن ۲۱) اگر هیچ سیاستی برای جلوگیری از افزایش دما اعمال نشود و همچنان اختصاص یارانه بر کربن ادامه داشته باشد، میانگین دمای جهانی تا ۴/۷۴ درجه سلسیوس و در صورتی که سیاست حذف یارانه‌های سوخت فسیلی اعمال شود، میانگین دمای جهانی تا ۴/۴۹ درجه سلسیوس و در صورت اجرای سیاست اصلاح یارانه‌های سوخت فسیلی (وضع قیمت بر کربن) میانگین دمای جهانی تا ۴/۲۴ درجه سلسیوس افزایش خواهد یافت. به طور کلی، وضع مالیات بر کربن در منطقه منا میانگین افزایش دمای جهان را ۰,۵ درجه سانتیگراد در مقایسه با سایر سناریوها کاهش می‌دهد.

کلیدواژه‌ها: تغییر اقلیم؛ مدل یکپارچه‌ی پویای اقتصاد منطقه‌ای و آب و هوا؛ گرمایش جهانی؛ خاورمیانه و شمال آفریقا (MENA).

طبقه‌بندی JEL: Q43, Q51, D58, Q54

* r.moayedfar@ase.ui.ac.ir

تعیین‌کنندگان مالی اعتبار بانک مرکزی: شواهدی از کشورهای IT

الهام کمال*
 وحید تقی نژادعمران

: دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران.
 : دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران.

چکیده

از دهه ۱۹۹۰ و پذیرش چارچوب هدف‌گذاری تورم، اعتبار به عنوان ابزاری معرفی گردید که بانک مرکزی می‌تواند از طریق آن انتظارات تورمی را کنترل و نزدیک به تورم هدف نگه دارد. اما اعتبار خود تابعی از عواملی بیرونی همچون مالی است که می‌تواند نقشی تعیین‌کننده بر کسب اعتبار و توانایی بانک مرکزی در راستای اجرای تعهداتش بگذارد. از آنجا که بسیاری از پژوهشگران عوامل تعیین‌کننده اعتبار بانک مرکزی را نادیده گرفته‌اند، در مطالعه حاضر عوامل مالی تعیین‌کننده اعتبار با استفاده از تجزیه و تحلیل کوانتایل برای ۲۵ کشور که چارچوب هدف‌گذاری تورم را به صورت رسمی پذیرفته‌اند در طی سال‌های ۲۰۱۴-۱۹۹۰ مورد بررسی قرار می‌گیرد. نتایج نشان می‌دهد که قواعد مالی در دنباله‌های پایین بر اعتبار بانک مرکزی تاثیرگذار است در حالی که پولی کردن بدهی در کوانتایل‌های بالا و زمانی که اعتبار بانک مرکزی بالا است می‌تواند اثر منفی بر نگاه مردم و انتظارات تورمی آنها گذاشته و موجب کاهش اعتماد به توانایی و کسب اعتبار بانک مرکزی گردد.

کلیدواژه‌ها: اعتبار بانک مرکزی؛ چارچوب هدف‌گذاری تورم؛ تعیین‌کنندگان مالی؛ رگرسیون کوانتایل.
 طبقه‌بندی JEL: E50, E52, E58.

* elhank098@gmail.com

اثر استراتژی توسعه بر رشد اقتصادی ایران: رویکرد اقتصاد ساختارگرایی جدید

سید روح اله احمدی حاجی آبادی* : گروه اقتصاد، دانشگاه دامغان، دامغان، ایران.
جبار الحق : گروه اقتصاد، دانشگاه سرگودها، پنجاب، پاکستان.
هوبرت ویساس : گروه اقتصاد و تجارت بین الملل، دانشگاه اقتصاد و تجارت بین الملل، پکن، چین.

چکیده

مقاله حاضر با هدف آزمون فرضیه اقتصاد ساختارگرایی جدید با توجه به تأثیر استراتژی توسعه بر رشد اقتصادی در کشوری که شاهد جنگ هشت ساله بوده و تحریم‌های شدیدی را متحمل شده، یعنی ایران انجام گرفته است. بر اساس دیدگاه اقتصاد ساختارگرایی جدید، اگر یک کشور استراتژی مخالف مزیت نسبی را اتخاذ کند، عملکرد رشد ضعیفی خواهد داشت. در مقابل، برای داشتن یک رشد اقتصادی قوی، باید از استراتژی پیروی از مزیت نسبی تبعیت کند. شاخص انتخاب فناوری (TCI) به عنوان نماینده استراتژی توسعه استفاده می‌شود. بر اساس این شاخص، افزایش TCI به این معنی است که یک کشور در حال اجرای استراتژی نادیده گرفتن مزیت نسبی است. این رابطه با رویکرد آزمون کرانه‌های ARDL برآورد شده است. برای اجرای مدل، شاخص انتخاب فناوری (TCI) و انواع متغیرهای کنترلی در مدل گنجانده شد. از این رو، داده‌های سری زمانی از پایگاه‌های داده قابل اعتماد برای دوره ۱۹۷۹-۲۰۱۸ جمع‌آوری شد. نتایجی که ثبات آنها بررسی شده است، تأثیر منفی اتخاذ استراتژی مقابله با مزیت نسبی بر رشد اقتصادی را نشان می‌دهد که از فرضیه لین پشتیبانی می‌کند. به عبارت دیگر، نشان داده می‌شود که با افزایش TCI، رشد اقتصادی به طور قابل توجهی کاهش می‌یابد. بنابراین برای دستیابی به رشد اقتصادی باید نوعی استراتژی توسعه اتخاذ شود که مبتنی بر پیروی از مزیت نسبی باشد.

کلیدواژه‌ها: اقتصاد ساختارگرایی جدید؛ مزیت نسبی؛ استراتژی توسعه؛ ARDL Bounds؛ ایران.
طبقه‌بندی JEL: O53, O47, O14, O11.

* seyedahmadi@du.ac.ir

تأثیر شفافیت (اطلاعات) و استقلال بانک مرکزی بر رشد بهره‌وری در ایران

نسرین منصوری
 گروه اقتصاد، دانشگاه پیام نور، تهران، ایران.
 بهروز صادقی عمروآبادی*
 گروه اقتصاد، دانشگاه شهید چمران اهواز، اهواز، ایران.

چکیده

این پژوهش به بررسی تأثیر شفافیت و استقلال بانک‌های مرکزی بر رشد بهره‌وری طی سال‌های ۱۳۶۰ تا ۱۳۹۷ در اقتصاد ایران پرداخته است. شفافیت و استقلال بانک مرکزی به ترتیب با شاخص دینسر و آیچنگرین (۲۰۱۲) و شاخص کوکرمین (۱۹۹۳) اندازه‌گیری شد. متغیرهای این تحقیق که به صورت سالانه می‌باشند عبارتند از: شفافیت بانک مرکزی، استقلال بانک مرکزی، رشد تولید ناخالص داخلی، رشد بهره‌وری، نرخ تورم و تجارت آزاد. برای تخمین مدل از روش خودرگرسیون با وقفه‌های توزیعی (ARDL) استفاده شد. ضریب تصحیح خطا منفی، از نظر آماری معنی‌دار و برابر با $-0/308$ است. نتیجه‌گیری می‌شود که ۳۰ درصد از عدم تعادل در کوتاه‌مدت برای دستیابی به تعادل بلندمدت تعدیل می‌شود. نتایج نشان می‌دهد که شفافیت بانک مرکزی بر رشد بهره‌وری کوتاه‌مدت تأثیر مثبت دارد و ضریب آن برابر با $0/36$ است، اما بر رشد بهره‌وری بلندمدت معادل $1/08$ مؤثر است. در این تحقیق از شاخص کوکرمین و نیاپتی (۱۹۹۲) برای محاسبه استقلال بانک مرکزی استفاده شد. علاوه بر این، از شاخص دینسر و آیچنگرین (۲۰۱۲) برای شاخص شفافیت استفاده شد. با توجه به تأثیر مثبت شفافیت بانک مرکزی بر رشد بهره‌وری، بانک مرکزی باید به طور مستمر شفاف‌سازی سیاست‌ها و انتشار اطلاعات دریاقتی متغیرهای کلان اقتصادی را در طول یک ماه ترویج دهد.

کلیدواژه‌ها: شاخص دینسر و آیچنگرین؛ شاخص کوکرمین؛ استقلال؛ بانک مرکزی؛ شفافیت؛ بهره‌وری کل عوامل.

طبقه‌بندی JEL: O43, J24, E58

* B.sadeghi@scu.ac.ir

آیا شوک مخارج دولت در رونق مالی موثرتر است یا در دوران رکود؟

سمیه رسولی فیروزآبادی* : گروه اقتصاد، دانشگاه سیستان و بلوچستان، زاهدان، ایران.
نظر دهمرده : گروه اقتصاد، دانشگاه سیستان و بلوچستان، زاهدان، ایران.
محمد نبی شهیکلی تاش : گروه اقتصاد، دانشگاه سیستان و بلوچستان، زاهدان، ایران.

چکیده

هدف اصلی مقاله حاضر بررسی تاثیر شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت در طی ادوار مالی بر متغیرهای اقتصادی ایران با استفاده از داده‌های فصلی دوره ۱۳۸۴-۱۳۹۷ است. ارتباط بین بخش مالی و بخش واقعی اقتصاد سبب اهمیت بازارهای مالی خواهد شد. بدین منظور ابتدا شاخص شرایط مالی با استفاده از روش تحلیل مولفه‌های اساسی ایجاد گردید. نتایج مدل خودرگرسیون برداری آستانه نشان داد شاخص شرایط مالی سبب غیر خطی شدن رابطه میان متغیرها خواهد شد. ارزش متغیر آستانه شاخص مالی ۰٫۳۶- تعیین گردید. فصل‌های کمتر از متغیر آستانه نشان‌دهنده دوره رکود و بالاتر از متغیر آستانه نشان‌دهنده دوره رونق مالی است. سپس با استفاده از روش شبیه‌سازی مدل خودرگرسیون برداری آستانه‌ای و بوت استرپ ۵۰۰ بار تکرار تا ۲۰ دوره در دو رژیم بالا و پایین محاسبه گردید بر اساس نتایج، واکنش متغیرهای اقتصادی به شوک‌های مثبت مخارج دولت مستقل از چرخه مالی خواهد بود، در حالی که واکنش به شوک‌های منفی در مخارج دولت تحت تأثیر چرخه مالی به‌ویژه در دوره رکود است.

کلیدواژه‌ها: مدل خودرگرسیون برداری آستانه؛ شوک مخارج دولت؛ چرخه مالی؛ توابع واکنش - ضربه تعمیم یافته.

طبقه بندی JEL: H11, H5, H3

* somayerasouli98@yahoo.com

نرخ بهینه مالیات و کارایی دولت در کشورهای با درآمد متوسط بالا و پایین و کشورهای منتخب عضو سازمان همکاری اسلامی: رویکرد فرامرزی

کلناز هادیان : گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران.
سارا قبادی* : گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران.
مجید صامتی : دانشکده اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران

چکیده

با مطرح شدن نقش دولت در الگوهای رشد اقتصادی در پی اهمیت یافتن موضوع مالیات‌گیری و خرج آن در جهت بهبود رشد اقتصادی و رفاه جامعه، تعدادی از اقتصاددانان اقدام به ارائه الگوهایی برای تعیین نرخ بهینه مالیات حداکثرکننده رشد اقتصادی نموده‌اند. مقاله حاضر به پیروی از این اقتصاددانان و با ارائه رویکردی جدید بر مبنای روش تحلیل فرامرزی تصادفی متکی بر امکان وجود ناکارایی فنی در رفتار دولت‌ها، اقدام به تعیین کارایی فنی دولت‌ها نسبت به هر دو مرز گروهی و فرامرزی به همراه نسبت فراتکنولوژی آن‌ها طی دوره ۱۹۹۶-۲۰۱۸ در منتخبی از کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی (گروه A)، کشورهای با درآمد متوسط پایین (گروه B) و کشورهای با درآمد متوسط بالا (گروه C) می‌نماید. سپس از طریق نتایج الگوی برآوردی به تحلیل مقادیر متوسط نرخ مالیات بهینه حداکثرکننده رشد اقتصادی کشورهای مورد بررسی می‌پردازد. نتایج حاصل گویای آن است که بالاترین متوسط هر سه شاخص کارایی فنی، کارایی فرامرزی و نسبت شکاف تکنولوژی در اختیار گروه کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی است و کمترین متوسط نسبت فراتکنولوژی متعلق به اکثر کشورهای گروه با درآمد متوسط پایین است. همچنین در بین کشورها، روسیه بیشترین مقدار هر سه شاخص را دارا است و می‌تواند به‌عنوان الگوی سایر کشورها در نظر گرفته شود. درنهایت با اطمینان ۹۰٪ می‌توان عنوان نمود که در کشورهای ایران و کویت مقدار متوسط نرخ واقعی مالیات در طول دوره مورد بررسی کمتر از نرخ بهینه مالیات بر مبنای بودجه متوازن بوده است.

کلیدواژه‌ها: مدل رشد درونزا؛ نرخ بهینه مالیات؛ کارایی تکنیکی دولت؛ تابع تولید فرامرزی؛ نسبت شکاف تکنولوژی.
طبقه‌بندی JEL: C23, C51, E23, E60, H21, H60

* sghobadi@khuisf.ac.ir

تأثیر مشارکت بخش خصوصی و دولتی بر تجارت: مناطق آزاد ایران

فاطمه اعتمادمقدم : گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران.
مجید صامتی* : گروه اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران.
سارا قبادی : گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد اصفهان (خوراسگان)، اصفهان، ایران.
منصور مهینی زاده : گروه اقتصاد، دانشکده اقتصاد، مدیریت و حسابداری، دانشگاه یزد، یزد، ایران.

چکیده

در تلاش برای دستیابی به رشد و توسعه اقتصادی، حذف یا به حداقل رساندن موانع سنتی تجارت، تسهیل تجارت (TF) و افزایش تجارت بین‌المللی، مناطق آزاد تجاری در ایران تأسیس شد. در این راستا، بخشی از راه‌حل افزایش تجارت بین‌المللی کشورها توسط مشارکت‌های دولتی و خصوصی ارائه می‌شود. از آنجایی که تسهیل تجارت شامل رابطه بین عوامل دولتی و خصوصی است، این نوع مشارکت در تسهیل تجارت اهمیت ویژه‌ای دارد. هدف از این تحقیق بررسی رابطه عواملی است که بیشترین تأثیر را بر PPPهای TF محور در مناطق آزاد دارند و این عوامل برگرفته از تئوری PPPها هستند. داده‌های کیفی با تمرکز بر متخصصان بخش خصوصی، دولتی و دانشگاهی درگیر در مناطق آزاد و تجاری توسط پرسش‌نامه محقق ساخته جمع‌آوری و برای بررسی مدل و آزمون فرضیه‌های تحقیق از روش مدل‌سازی معادلات ساختاری (SEM) استفاده شد. از ۵ فرضیه مطرح شده در این پژوهش، چهار فرضیه تأیید و یک فرضیه رد گردید. نتایج نشان می‌دهد که متغیرهای توانایی‌های بخش خصوصی، عوامل محیطی خرد و عوامل محیطی کلان به ترتیب بیشترین تأثیر را بر PPPهای TF محور دارند و PPPهای TF گرا رابطه قوی با تسهیل تجارت دارند. بنابراین استفاده از PPPهای TF محور در مناطق آزاد می‌تواند تأثیر مثبتی بر تسهیل تجارت داشته باشد و توسعه ابعاد TF نیز موجب تسهیل تجارت در مناطق آزاد ایران خواهد شد.

کلیدواژه‌ها: مشارکت بخش خصوصی و دولتی؛ تسهیل تجارت؛ معادلات ساختاری؛ مناطق آزاد.

طبقه‌بندی JEL: C10, F19, O19

* majidsameti@ase.ui.ac.ir

بررسی اثرات سرریز فضایی ناامنی بر جذب گردشگر در استان های کشور

سیاوش جانی*

: گروه اقتصاد، دانشگاه پیام نور، ایران.

وحید نیک پی پسیان

: گروه اقتصاد، دانشگاه اورمیه، ارومیه، ایران.

چکیده

یکی از تأثیرگذارترین عوامل در رونق گردشگری، امنیت مقاصد گردشگری و همچنین امنیت مناطق مجاور مقاصد گردشگری است. بر این اساس در این مطالعه تاثیر ناامنی مقاصد گردشگری و مناطق مجاور آنها بر تعداد گردشگر در بین استان های کشور با رویکرد اقتصاد سنجی فضایی مورد بررسی قرار گرفت. شاخص ناامنی در این مطالعه به صورت یک شاخص ترکیبی براساس رویکرد مولفه های اصلی و با استفاده از داده های قتل، نزاع و درگیری، شرارت، زورگیری و باجگیری، چاقو و قمه کشی و خودکشی های استان ها بدست آمده است. همچنین وابستگی فضایی مثبت بین استان ها براساس نتایج حاصل از آزمون های تشخیصی، مورد تایید قرار گرفته و مدل تحقیق در چارچوب داده های تابلویی فضایی پویا براساس تخمین زن دوربین فضایی طی دوره ۱۳۹۶-۱۳۹۰ برآورد گردیده است.

نتایج حاصل از برآورد مدل حاکی از آن بود که افزایش ناامنی در یک منطقه علاوه بر اینکه موجب کاهش تعداد گردشگر آن منطقه می شود (اثرات مستقیم) بلکه تعداد گردشگران مناطق مجاور را نیز به طور معنی داری کاهش می دهد (اثرات سرریز فضایی). در ادامه تحلیل نتایج نشان داد که اثرات فضایی شاخص ناامنی بزرگتر از اثرات مستقیم آن است به این معنی که افزایش ناامنی در یک استان بیش از آنکه تعداد گردشگران آن استان را کاهش دهد، موجب کاهش تعداد گردشگران استان های مجاور می شود. همچنین براساس نتایج بدست آمده علاوه بر ناامنی، تعداد پزشک متخصص، تعداد مراکز فرهنگی و همچنین شاخص فن آوری اطلاعات و ارتباطات به ترتیب بیشترین تاثیر را بر جذب گردشگر استان ها داشتند.

کلیدواژه ها: گردشگری؛ اثرات سرریز فضایی؛ امنیت.

طبقه بندی JEL: L83، F52، H55

* S.jani@pnu.ac.ir