

دانشگاه تربیت مدرس
دانشکده علوم انسانی
پایان نامه کارشناسی ارشد

موضوع :

محاسبه و آزمون تورش همفزون در برآورد تابع تقاضای سرمایه گذاری همفزون
بخش خصوصی ایران

استاد راهنما: جناب آقای دکتر مرتضی قره باغیان
استاد مشاور: جناب آقای دکتر حمید ابریشمی
نگارش: غلامرضا کشاورز حداد
سال تحصیلی: پاییز ۱۳۷۳

فهرست مطالب

فصل اول :

کلیات

- ۱-۱- بیان مسئله
- ۲-۱- فرضیه های تحقیق
- ۳-۱- اهداف تحقیق
- ۴-۱- سوابق مربوط به تحقیق
- ۵-۱- روش تحقیق

فصل دوم:

تعریف مفاهیم و سیری در نوشتارهای پیشین نظریه همفزونی

- ۱-۱- تعریف جمعی سازی
- ۲-۲- روابط خرد و روابط کلان
- ۲-۳- اصول جمعی سازی
- ۲-۴- انواع جمعی سازی
- ۲-۴-۱- جمعی سازی بر روی مجموعه ای از افراد

- ۲-۴-۲- جمعی سازی بر روی کالاها
- ۲-۴-۳- جمعی سازی بر روی زمان
- ۲-۵- پیشینه تحقیق پیرامون جمعی سازی بر روی افراد
- ۲-۵-۱- تایل و همفزونی خطی
- ۲-۵-۲- بوت & د - ویت و خطای ضمنی نمونه گیری
- ۲-۵-۳- گرونفلد و گرلیچز و ضریب تعیین مرکب
- ۲-۵-۴- کلاک و روش نمادگذاری ماتریس نظریه همفزونی
- ۲-۵-۵- بررسی های تجربی K.L.Gupta از نظریه همفزونی تایل
- ۲-۵-۶- آرنولد زلنر و شیوه جدیدی وی در برآورد معادلات خرد
- ۲-۵-۷- ادوین کوه و کاربرد مدل‌های با ضرایب تصادفی در نظریه جمعی سازی
- ۲-۵-۸- تاکس لاول و تعریف وی از مفهوم تورش همفزونی
- ۲-۵-۹- کومی ساساکی و اریب در معیار پیش بینی
- ۲-۵-۱۰- آلن وینترز و جمعی سازی در مدل‌های لگاریتمی - تجربه هایی از مدل صادرات بریتانیا
- ۲-۵-۱۱- پسران - پیرس - کومار و رهیافت جدید آنها
در محاسبه ضریب تعیین تعمیم یافته
- ۲-۵-۱۲- پسران - پیرس - لی و آزمون تورش همفزونی
- ۲-۵-۱۳- بهرام وهابی و محاسبه تجربی اریب جمعی سازی
در تابع مصرف جمعی ایران

فصل سوم :

موضوعات اساسی در نظریه همفزونی روابط خطی

- ۳-۱- روشهای جمعی سازی
- ۳-۱-۱- روشهای جمعی سازی کلاین
- ۳-۱-۲- روشهای جمعی سازی اول تایل
- ۳-۱-۳- روش جمعی سازی دوم تایل
- ۳-۲- تورش همفزونی در پارامترهای کلان
- ۳-۳- جمعی سازی روابط رگرسیونی با نگرش ماتریسی
- ۳-۴- تورش همفزونی و خطای ضمنی نمونه گیری در پارامترهای حداقل مربعات
- ۳-۵- جمعی سازی و پیش بینی متغیر وابسته جمعی
- ۳-۶- آزمونهای جمعی سازی کامل
- ۳-۶-۱- آزمون جمعی سازی کامل با استفاده از فرضیه برقراری شرط لازم سازگاری

۳-۷-آزمونهای مستقیم تورش همفزونی

۳-۷-۱-آزمون تورش همفزونی با استفاده از مقادیر شبه واقعی برای بردار b

۳-۷-۲-آزمون مستقیم تورش همفزونی با استفاده OLS برای بردار b

۳-۷-۳-آزمون مستقیم تورش همفزونی با استفاده از تخمین زندهای SURE برای

پارامترهای روابط خرد

فصل چهارم :

مروری بر نظریه های سرمایه گذاری و موضوع تشکیل سرمایه

۴-۱- تعریف سرمایه گذاری و مفهوم آن

۴-۲- سرمایه گذاری برنامه ریزی شده و سرمایه گذاری تحقق یافته

۴-۳- اصل شتاب ساده سرمایه گذاری

۴-۴- نظریه شتاب انعطاف پذیر سرمایه گذاری

۴-۵- نظریه نئو کلاسیک سرمایه گذاری

۴-۶- نظریه سود/ نقدینگی سرمایه گذاری

۴-۷- مدل سرمایه گذاری آیزنر

۴-۸- تئوری سرمایه گذاری Q توبین

۴-۹- جمع بندی کلی نظریه های سرمایه گذاری

۴-۱۰- عوامل تعیین کننده سرمایه گذاری در کشورهای در حال توسعه

۴-۱۰- الف - مخارج دولت

۴-۱۰- ب- امکان دسترسی به منابع مالی

۴-۱۰- ج- سود آوری و ساختار بازار

۴-۱۰- د - عدم اطمینان

۴-۱۰- ه - بدهی های خارجی

فصل پنجم:

روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص

۵-۱- مقدمه ، تعاریف و روش تحلیل

۵-۲- شوکهای نفتی و اثرات آنها

۵-۳- تحلیل روند بلند مدت متغیرهای سرمایه گذاری با استفاده از آزمون ریشه واحد ، مبانی

نظری

۵-۴- روند تغییرات تشکیل سرمایه ثابت ناخالص جمعی در اقتصاد ایران

- ۵-۵- روند سهم تشکیل سرمایه ناخالص داخلی در تولید ناخالص داخلی
- ۵-۶- مخارج داخلی و تشکیل سرمایه ثابت
- ۵-۷- تحلیل روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص بر حسب فعالیتهای اقتصادی
- ۵-۷-۱- روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در بخش مسکن (مستغلات) ۱۲۴
- ۵-۷-۲- روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در بخش کشاورزی
- ۵-۷-۳- روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در بخش خدمات (منهای مستغلات)
- ۵-۷-۴- روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در بخش آب و برق
- ۵-۷-۵- روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در بخش نفت و گاز
- ۵-۷-۶- روند تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در بخش صنعت و معدن

فصل ششم:

مشخص نمایی نظری مدل اقتصاد سنجی و نتایج تجربی

- ۶-۱- مروری بر تصریح معادلات سرمایه گذاری در مدل‌های کلان سنجی ایران
- ۶-۲- تحلیل تجربی تاثیر همفزونی بر تابع تقاضای سرمایه گذاری همفزون ایران
- ۶-۳- تصریح و ارائه مدل نظری
- ۶-۴- روش برآورد و تحلیل
- ۶-۴-۱- روش تحلیل
- ۶-۴-۱- الف - ۱- روش تحلیل ساختار ضرایب برآورد شده، معادله کلان
- ۶-۴-۱- الف - ۲- آزمون معنی دار بودن تورش همفزونی
- ۶-۵- برآورد روابط رگرسیونی خرد و رابطه جمعی
- ۶-۶- برآورد روابط کمکی و بررسی شرایط سازگاری تایل
- ۶-۷- محاسبه تورش همفزونی وارزیابی تاثیر آن بر مسیر زمانی متغیر جمعی تقاضای سرمایه گذاری
- ۶-۸- آزمون تورش همفزونی
- خلاصه و نتیجه گیری

چکیده:

موضوع همفزونی بر روی واحدهای خرد بعد از آثار پیشگام تاییل (۱۹۵۴) دارای حدیثی طولانی در ادبیات اقتصاد سنجی بوده است. در این ادبیات دو موضوع خاص مورد تاکید بوده است، مسئله اول بر پیش بینی و بکارگیری معادلات کلان در مقابل معادلات تفکیک سازی شده برای پیش بینی متغیر همفزون تمرکز دارد. این موضوع توسط گرونفلند و گرلیچر (۱۹۶۰) و پسران، پیرس و کومار (۱۹۸۹) ارائه و گسترش داده شد. نوشتار حاضر به بررسی مسیر دوم این ادبیات یعنی محاسبه و آزمون تورش همفزونی یعنی انحراف پارامترهای کلان از میانگین پارامترهای خرد... در تابع تقاضای سرمایه گذاری همفزونی بخش خصوصی ایران می پردازد. تابع آزمون مستقیمی برای آزمون فرضیه تورش همفزونی با بکارگیری تخمین زندهای SURE برای روابط خرد OLS برای رابطه کلان ارائه می گردد.

ابزارهای ارائه شده برای آزمون تورش همفزونی در توابع تقاضای سرمایه گذاری بخش خصوصی در زیر بخشهای اقتصادی ایران بعنوان واحدی خرد و مجموع آن بعنوان تقاضای همفزون بکار بسته شده اند.

روابط خرد تصریح شده با بکارگیری ساز و کار شتاب انعطاف پذیر تعمیم یافته استخراج شده و سپس با بکارگیری روشهای یاد شده در بالا بصورت مقید (قیدهای صفری) برآورد گردیده اند. اعمال قید روی پارامترهای خرد نتایج جالب توجهی را در محاسبه تورش همفزونی بدست داده و فرضیه معنی دار نبودن تورش پذیرفته نمی شود.