

دانشگاه امام صادق (ع)  
دانشکده معارف اسلامی و اقتصاد  
پایان نامه کارشناسی ارشد

عنوان:

تئوری و کاربرد الگوهای سرمایه گذاری

نویسنده: داود منظور

استاد راهنما: مسعود درخشان

استاد مشاور: حمید ابریشمی، حمید ناظمان

سال تحصیلی: بهمن ۱۳۶۹

توصیفگر: ۱۹۷ ص. : جدول ، نمودار. شماره بازیابی ۱۵۸ الف.

واژگان کلیدی: الگوها / سرمایه گذاری

چکیده:

هدف از پژوهش حاضر ، بررسی الگوهای سرمایه گذاری از جنبه های نظری و کاربردی است. تحقیق حاضر که به روش کتابخانه ای انجام گرفته ، مشتمل بر پنج فصل است . در فصل اول ، رهیافتهای مختلف در الگوسازی تشکیل سرمایه ثابت بررسی شده ویافته های مطالعات تجربی به طور مقایسه ای مورد ارزیابی قرار می گیرد. فصل دوم به گروه الگوهای شتاب در سرمایه گذاری اختصاص دارد. در این فصل الگوی شتاب ساده و الگوی شتاب انعطاف پذیر بررسی می شوند . در این راستا ، روش تبدیلی کوچک تبیین شده ، روشهای تخمین حداکثر درستنمایی و متغیرهای کمکی جهت تخمین ساختارهای تأخیرات توزیعی هندسی مورد بحث واقع می شوند. پس از آن جهت

بررسی اصل شتاب به صورت تجربی فرضیه " ایزنر " یا "در آمد دائمی " در سرمایه گذاری مورد تجزیه و تحلیل قرار میگیرد. فصول سوم و چهارم اختصاص به معرفی الگوهای سرمایه گذاری نئوکلاسیک دارد. فصل سوم الگوی "جورگنسون " را بررسی می کند و مدل " بیشاف " در فصل چهارم مورد تجزیه و تحلیل قرار میگیرد. در این فصل پس از توصیف الگوی تأخیرات توزیع مجددا الگوی جورگنسون به عنوان حالت حاصلی از مدل بیشاف مورد بحث واقع شده و روش تخمین پارامترهای مدل بیان میگرد و تخمینی غیر خطی از الگوی بیشاف ارائه میگردد و تخمینی غیر خطی از الگوی بیشاف ارائه می گردد. در فصل پنجم ، انتظارات قیمت ، تغییرات تکنولوژی وعدم اطمینان در الگوی سرمایه گذاری نئوکلاسیک مورد بحث قرار می گیرد. در این فصل ابتدا تأثیر تغییر انتظارات قیمت و تکنولوژی بر نسبت بهینه سرمایه به محصول بررسی میگردد و پس از استخراج تابع سرمایه گذاری ، نقش عدم اطمینان قیمت و هزینه در سرمایه گذاری به همراه توصیف الگوی " هارتمن " مورد بحث واقع می شود.