

عنوان مقاله:

بررسی اثر استرس مالی بر رونق و رکود اقتصادی و پیش بینی رونق و رکود اقتصادی به روش شبکه عصبی مصنوعی در ایران

محل انتشار:

سومین همایش ملی مطالعات جدید در کارآفرینی و مدیریت کسب و کار (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

مرصیه ابراهیمی شقاقی - گروه حسابداری و مدیریت، واحد شهریار، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

حسین اسلامی مفید آبادی - گروه حسابداری و مدیریت، واحد شهریار، دانشگاه آزاد اسلامی، تهران، ایران

خلاصه مقاله:

تجزیه و تحلیل دقیق استرس مالی ابزاری مهم در گستره چهارچوب سیاست های محافظه کارانه خرد و کلان است. همچنین علاوه بر نظارت و سرپرستی بر سیستم مالی، تجزیه و تحلیل استرس مالی جهت درک تاثیر شوک های مالی در اقتصاد بسیار مهم است. هدف از این مقاله در مرحله اول بررسی اثر استرس مالی بر رونق و رکود اقتصادی و در مرحله دوم تاثیر استرس مالی بر رونق و رکود اقتصادی است. بدین منظور، از روش پرسپترون چندلایه استفاده شده است. در این راستا تاثیر متغیرهایی نظیر قیمت نفت، حجم پول، مخارج دولت، تورم و استرس مالی را بر روی رکود و رونق اقتصادی بررسی نموده و بدین منظور ابتدا آزمون ساکن پذیری بر روی تک تک متغیرها انجام شده و بر اساس نتایج نهایی از آنجایی که متغیرهای مدل به صورت ترکیبی از $I(0)$ و $I(1)$ می باشد، از مدل خود توضیح با وقفه های توزیع شده (ARDL) برای تخمین استفاده می شود. براساس نتایج به دست آمده از مدل خود توضیح با وقفه های توزیع شده (ARDL) می توان گفت که استرس مالی بر رونق اقتصادی تاثیر منفی و معنی داری دارد. یعنی در اثر افزایش به میزان یک درصد، رونق اقتصادی به میزان 0.029% درصد کاهش یافته است. زیرا با افزایش استرس مالی، هزینه سرمایه گذاری افزایش می یابد که این امر باعث کاهش تولید می شود. استرس مالی بر رکود اقتصادی تاثیر مثبت و معنی داری دارد، یعنی در اثر افزایش استرس مالی به میزان یک درصد، رکود 0.13% افزایش می یابد. براساس نتایج به دست آمده، پیش بینی می شود از سال 1397 تا فصل اول 1399 همچنان اقتصاد در حال رکود باشد و با شروع فصل دوم 1399 شاهد رونق اقتصادی باشیم با توجه به نتایج به دست آمده استرس مالی در تشخیص رکود و رونق اقتصادی نقش به سزایی دارد.

کلمات کلیدی:

استرس مالی، شاخص نااطمینانی استرس مالی، رونق و رکود اقتصادی، شبکه عصبی

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1380599>

