

عنوان مقاله:

اثر نااطمینانی در بازدهی سرمایه بر رشد اقتصادی؛ مطالعه موردی ایران

محل انتشار:

فصلنامه پژوهش های رشد و توسعه اقتصادی، دوره 3، شماره 12 (سال: 1392)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

ابوالقاسم اثنی عشری - دانشیار دانشگاه پیام نور

محمدحسین پورکاظمی - دانشیار دانشکده علوم اقتصادی و سیاسی دانشگاه شهید بهشتی

اصغر ابوالحسنی هستیانی - استادیار گروه اقتصاد دانشگاه پیام نور

احمد لطفی مزرعه شاهی - دانشجوی دکتری علوم اقتصادی

خلاصه مقاله:

پس اندازه‌های داخلی یکی از مهمترین منابع تامین مالی سرمایه و رشد اقتصادی محسوب میشوند این پس اندازه‌ها باریسک بازدهی سرمایه مواجه اند نااطمینانی در بازدهی سرمایه میتواند منجر به انحراف تصمیمات عوامل اقتصادی در زمینه پس انداز مصرف و سرمایه گذاری شود و بسته به نوع رفتار مردم باعث تغییر در نرخ رشد اقتصادی گردد مطالعه حاضر نرخ رشد اقتصادی را تحت نااطمینانی در بازدهی سرمایه با حرکت براونی استاندارد با استفاده از کنترل بهینه تصادفی محاسبه و آن را با نرخ رشد اقتصادی متعین مقایسه می کند نتایج بیانگر آن است که اگر ضریب ریسک گریزی نسبی کمتر از واحد باشد متوسط نرخ رشد بلندمدت اقتصادی تصادفی از متعین کمتر خواهد بود و با افزایش میزان نااطمینانی در بازدهی سرمایه رشد اقتصادی کاهش می یابد همچنین با استفاده از داده های اقتصاد ایران در دوره 1389-1353 ابتدا بر پایه معادله دیفرانسیل تصادفی مدلی پویا برای تولید ناخالص داخلی شبیه سازی و متوسط نرخ رشد 3.85 درصد برآورد شد سپس رابطه بین نااطمینانی بازدهی سرمایه حاصل از مدل واریانس ناهمسانی شرطی خودرگرسیون تعمیم یافته نمایی و نرخ رشد اقتصادی بررسی و مشخص گردید که طی این دوره رشد اقتصادی ایران با نوسانات بازدهی سرمایه رابطه یا منفی داشته است

کلمات کلیدی:

فرضیه نااطمینانی / نرخ بازدهی سرمایه / رشد اقتصادی / مدل EGARCH / ایران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/405400>

