



**بررسی اثر مخارج دولت
بر رخام در ایران
بار هیافت مدل پویای عادل عمومی تصادفی**

تألیف:

یکتا اشرفی



فیفا

سرشناسه: اشرفی، یکتا، ۱۳۴۹ -

عنوان و نام پدیدآور: بررسی اثر مخارج دولت بر رفاه در ایران با رهیافت مدل پویای تعادل عمومی تصادفی/نگارش یکتا اشرفی.

موضوعات: نشر: تهران: نشر دانش ماندگار عصر، ۱۳۹۷.

مشخصات: ۲۰۲ ص.: جدول، نمودار؛ ۵/۱۴×۵/۲۱سم.

شابک: ۷-۰۰۵-۸۶۰۰-۶۰-۹۷۸

موضوع: سیاست مالی، - ایرار - تاریخ - قرن ۱۴

موضوع: History - Fiscal policy - 20th century

موضوع: رفاه اجتماعی - ایران Finance, Public

موضوع: Welfare economics رفاه اقتصاد

موضوع: خزانه و خزانه داری - ایران Revenue - Iran

موضوع: ایران - سیاست اقتصادی - قرن ۱۴

موضوع: Iran - Economic policy - 20th century

رده‌بندی کنگره: ۱۳۹۷ ۴ب۵الف/۴۷۳ HC

رده‌بندی دیویی: ۳۳۰/۰۹۵۵

شماره کتابشناسی ملی: ۵۳۹۳۱۳۲

شناسنامه

عنوان: بررسی اثر مخارج دولت بر رفاه در ایران بارهیافت مدل پویای تعادل

نویسنده: سید محمد

محل: دکتر یکتا اشرفی

وب استار: سید کاظمی

ناشر: سینه دانش ماندگار عصر

صفحه آرا: حسن محمدی

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۶۰۹-۰۹-۷

نوبت چاپ: اول پاییز ۱۳۹۰

تیراژ: ۵۰۰ نسخه

دفتر انتشارات: تهران، خیابان انقلاب، خیابان ۱۲ فروردین، خیابان لبافی نژاد، پلاک ۱۸۹

تلفن: ۶۰۹۰۴۱۱-۶

کدپستی: ۱۳۱۴۹۶۵۳۵۱

ایمیل و وب سایت: Info@mehrabanshop.com-MehrabanPub.com

فروشگاه اینترنتی: Ketabemehraban.com

تلفن فروشگاه نشر بازرگانی: ۶۶۹۵۳۴۷۵

کلیه حقوق و حق چاپ متن و عنوان کتاب که به ثبت رسیده است؛ مطابق با قانون حقوق مؤلفان و مصنفان مصوب ۱۳۴۸ محفوظ و متعلق به مترجم می باشد. هرگونه برداشت، تکثیر، کپی برداری به هر شکل (چاپ، فتوکپی، انتشار الکترونیکی) بدون اجازه ی کتبی از مؤلف نشر ممنوع بوده و متخلفین تحت پیگرد قانونی قرار خواهند گرفت.

دانش ماندگار عصر

فهرست مطالب

- ۱۱..... گفتار
- ۱۷..... فصل اول: سیاست‌های مالی در ادبیات اقتصادی
- ۱-۱-۱..... مقدمه ۱۷
- ۱-۲-۱..... سیاست‌های مالی و جریحه‌های تجاری کوتاه‌مدت ۲۰
- ۱-۳-۱..... ابزارها و آثار سیاست‌های مالی تأکید بر رفاه اقتصادی ۲۳
- ۱-۳-۱-۱..... ابزارها و معجزات، اثربخشی سیاست مالی ۲۳
- ۱-۳-۲..... درآمد‌های دولت ۲۴
- ۱-۳-۳-۱..... درآمد‌های مالیاتی ۲۴
- ۱-۳-۴..... درآمد‌های غیرمالیاتی ۲۵
- ۱-۳-۵..... مخارج دولت ۲۶
- ۱-۳-۶..... مخارج جاری دولت ۲۷
- ۱-۳-۷..... مخارج عمرانی دولت ۲۷
- ۱-۴-۱..... آثار مخارج دولت بر متغیرهای اقتصاد کلان ۳۰
- ۱-۴-۱-۱..... آثار جبرانی افزایش مخارج دولت بر مصرف خصوصی ۳۳

۳۴ ۱-۴-۲- اثر درآمدی مخارج دولت.

۳۶ ۱-۴-۳- اثر جانشینی مصرف-فراغت.

۱-۴-۴- اثر جدایی ناپذیری مخارج دولت و مصرف خصوصی (جانشینی/

مکملی اجورث) ۳۷

۱-۵-۱- اثر تکانه‌های مالی و جایگاه قواعد سیاست مالی ۳۸

۱-۵-۱- اثر دخالت دولت و تکانه‌های مالی ۳۸

۱-۵-۲- رامل ساختاری تأثیرگذار بر شوک‌های مالی ۳۸

۱-۵-۳- رامل بر ساختاری موثر بر ضرایب مالی ۴۰

۱-۶- قواعد مالی و آثار آن در کنترل شوک‌ها ۴۱

۱-۷- اهداف قواعد مالی ۴۳

۱-۸- کاربردهای قواعد مختلف بر اساس سیاست مالی به شوک‌ها ۴۶

۱-۹- آثار سیاست مالی بر فعالیت اقتصادی تحت صلاحدید و قواعد مالی ۴۸

فصل دوم: مفهوم سیاست پولی و اهمیت آن در نگاه مکتب اقتصادی ۵۳

۱-۲- مقدمه ۵۳

۲-۲- اثر سیاست‌ها و تکانه‌های پولی بر اقتصاد-کلاسیک مالی جدید ۵۴

۲-۳- اثر سیاست‌ها و تکانه‌های پولی بر اقتصاد-نظریه دور تجاری حقیقی ۵۶

۲-۳-۱- کارایی دوره‌های تجاری ۵۹

۲-۳-۲- اهمیت تکانه فناوری به عنوان منبع و دلیل نوسان‌های اقتصادی ۵۹

۲-۳-۳- نقش محدود عوامل پولی ۵۹

۶۱-۲-۴- اثر سیاست ها و تکانه های پولی بر اقتصاد- کینزی های جدید

۶۲-۲-۵- انواع الگوهای پولی در چارچوب الگوهای DSGE

۶۳-۲-۵-۱- الگوی پولی کلاسیک

۸۳-۲-۵-۲- الگوی پولی کینزی جدید

۹۱-۵-۱- سوم: مطلوبیت مصرف کننده و توابع رفاه اجتماعی

۹۱-۱- مقدمه

۹۳-۲- خواستاهای رفاه اجتماعی در رویکرد اقتصاد رفاه قدیم

۹۴-۳-۳- خواستگاه رفاه اجتماعی در رویکرد اقتصاد رفاه جدید پارتویی

۹۵-۳-۴- خواستگاه رفاه اجتماعی در رویکرد برگسون-سامونلسن

۹۵-۳-۵- تابع رفاه اجتماعی بر اساس تغییرهای کلان اقتصادی و بر پایه تابع زیان

۹۶- اجتماعی

۹۸-۳-۶- تحلیل های کلان اقتصادی با استفاده از مدل های عادل عمومی تصادفی

۹۸-۳-۷- بررسی اثر سیاست های پولی و مالی بر ساندن رفاه در مدل های

۱۰۸- کینزین های جدید

۱۰۸-۳-۷-۱- سیاست های پولی مدل های کینزین های جدید

۱۰۸-۳-۷-۲- بررسی اثر سیاست های مالی از کانال مخارج دولت در مدل های

۱۱۵- کینزین های جدید

فصل چهارم: طراحی مدل ۱۲۱

۱-۴- مقدمه ۱۲۱

۲-۴- بررسی داده‌های اصلی تحقیق در اقتصاد ایران ۱۲۱

۳-۴- طراحی الگوی DSGE در چارچوب نظریه کینزی جدید ۱۳۰

۱-۳-۴- خانوارها ۱۳۰

۲-۳-۴- بنگاه‌های تولیدکننده کالای نهایی و واسطه ۱۳۲

۱-۳-۱- دولت و مقام پولی ۱۳۷

فصل پنجم: خروجی‌های الگو ۱۴۱

۱-۵- مقدمه ۱۴۱

۲-۵- حل الگو ۱۴۱

۱-۲-۵- محاسبه شرایط تعادل ۱۴۳

۲-۲-۵- الگاریتمی خطی سازی الگو ۱۴۵

۳-۵- مقداردهی و شبیه سازی الگو ۱۴۹

۴-۵- نتایج حاصل از الگو ۱۵۳

۱-۴-۵- مقایسه گشتاورهای الگو ۱۵۳

۲-۴-۵- تجزیه واریانس ۱۵۴

۳-۴-۵- بررسی توابع عکس العمل آنی ۱۵۷

۴-۴-۵- بررسی اثر مخارج مصرفی و سرمایه گذاری دولت بر رفاه ۱۶۱

فصل ششم: خلاصه و پیشنهادات ۱۶۷

۶-۱- خلاصه ۱۶۷

۶-۲- ارائه پیشنهادها ۱۷۵

منابع و مأخذ ۱۷۹

پیوست‌ها ۱۹۳

پیوست ۱: لگاریتمی - خطی سازی ۱۹۳

پیوست ۱: مدارات ۱۹۶

www.ketab



پیشگفتار

تولید و رفاه از جمله مهم‌ترین شاخص‌های اقتصاد هستند که در ارزیابی عملکرد اقتصادی مورد استفاده قرار می‌گیرند. از جمله دلایل این امر، می‌توان به وسعت دامنه اثرگذاری و اثرپذیری متغیرهای فوق از سایر متغیرها اشاره کرد. واژه «Welfare» به حالتی از سلامت، شادی، سعادت، خوب بودن و مسالمتی به‌ویژه، به‌صورت پول، غذا و دیگر مایحتاج ضروری که به نیازمندان ارائه می‌شود، اشاره دارد. این واژه ابتدا به‌صورت مصدر «To Well Fare» به‌کار می‌رفت که معنای خوب بودن و خوش گذراندن بوده است. کلمه «Social» نیز نشان از ارتباط رفاه با جامعه و مقابله با خطراتی است که در زندگی جمعی با آن مواجه هستیم. در مجموع، این مفهوم به‌معنای حالتی از مناسب بودن و مطلوبیت به‌دست آمدن می‌باشد. بیش از سه دهه است که اقتصاددانان، آماردانان و روان‌شناسان صورت‌هایی به این مسئله پرداخته‌اند، به طوری که بررسی آثار سیاست‌های مالی، تولید و رفاه بخشی از ادبیات اقتصاد را به خود اختصاص داده است. سیاست‌های مالی، تصمیم‌گیری بخش خرد و کلان اقتصاد اثرگذار است. به طور سنتی، سیاست مالی تغییر در مخارج دولت، مالیات‌های مستقیم و غیرمستقیم و ایجاد تعادل بودجه، عنوان ابزار مدیریت تقاضا از طریق تغییر الگوی هزینه کالا و خدمات و توزیع مجدد درآمد و ثروت و همچنین، اثرگذاری بر سطح اشتغال و رفاه خانوار مورد استفاده قرار می‌گیرند. سیاست‌های مالی از ابزار اصلی دولت برای توزیع مجدد درآمد است، بنابراین، در شرایطی که افزایش نابرابری درآمد در اقتصادهای



پیشرفته یا در حال توسعه در حال افزایش است، اثر گذاری سیاست‌های مالی بر رشد اقتصادی و رفاه از اهمیت بسزایی برخوردار می‌شود. همچنین، در شرایطی که اقتصاد از حالت معمول خود بر اساس روند و سیکل‌های تجاری فاصله می‌گیرد، به‌عنوان مثال، زمانی که اقتصاد شوک‌های خارجی را تجربه می‌کند و اثر شرایط رکود است، برای کمک به هموارسازی آثار نوسان‌های تولید ملی، سیاست‌های مالی به‌عنوان ابزار مداخله دولت برای تصحیح موارد ناکامی بازار آزاد موثر بهره‌برداری قرار می‌گیرد.

در مقاله با توجه مطالعات تجربی که به ارزیابی اثر سیاست‌های پولی می‌پردازند، سیاست‌های مالی و آثار آن کمتر مورد توجه قرار گرفته است. در کنار وابستگی سیاست‌های مالی به تصمیمات سیاستی، پیچیدگی اثرگذاری این سیاست‌ها بر بخش‌های مختلف اقتصادی نیز از دیگر دلایل توجه کمتر مطالعات تجربی به این موضوع است. در نتیجه، در خصوص چگونگی اثرگذاری سیاست‌های مالی بر متغیرهای اقتصادی، اتفاق نظر کمتری وجود دارد (لیپر، ۲۰۱۰). پس از بحران‌های مالی جهانی در سال ۲۰۰۷ و بحث مربوط به نقش و اهمیت سیاست‌های مالی به‌عنوان یک محرک اقتصادی که می‌تواند بر فعالیت‌های اقتصادی در شرایط رکود مؤثر باشند، این سیاست‌ها مجدداً مورد توجه اقتصاددانان قرار گرفت (کلمن و همکاران، ۲۰۱۳).

وودفورد^۱، ۲۰۱۱ و آلفونسو و همکاران^۲، ۲۰۱۰).

اهمیت دیگر اثرگذاری سیاست‌های مالی به‌عنوان جایگزینی برای سیاست پولی این است که در برخی کشورها و پس از بحران‌های مالی نرخ بهره اسمی به‌عنوان یک هدف اصلی عملیاتی برای سیاست‌های پولی، نزدیک صفر شده یا به شرایطی قرار دارد که امکان استفاده از آن وجود ندارد. در نتیجه، نمی‌توان از کاهش نرخ بهره به‌عنوان یک سیاست انقباضی به‌منظور عبور از شرایط رکود استفاده کرد. در این شرایط، افزایش مخارج دولت یکی از گزینه‌های انتخابی توسط دولت بوده است و نقش دولت در جریان‌های اقتصادی با شتاب درخور توجهی افزایش می‌یابد. این شتاب در ایجاد سازمان‌ها، بنگاه‌ها و دخالت‌هایی است که منجر به افزایش سهم دولت از درآمد ملی می‌شود. در این خصوص، در اقتصادهایی که درآمد دولت‌ها به عوامل خارج از کنترل آنها وابسته است؛ تکانه‌های برون‌زایی درآمد و به تبع آن مخارج دولت‌ها را متأثر می‌کند، به گونه‌ای که کشورهایمانند ایران به وابستگی بودجه دولت به درآمدهای نفتی بسیار زیاد است، واکنش سیاست مالی دولت به نوسان‌های درآمد نفتی، مکانیزم انتشار برای این نوسان‌ها به‌شمار می‌رود. بررسی آثار مخارج دولت از اهمیت قابل توجهی برخوردار است، بنابراین، در این تحقیق به بررسی آثار مخارج دولت بر رفاه پرداخته شده است.

اقتصاد ایران، در نیم قرن اخیر نوسان‌های بسیاری را در تولید تجربه کرده

1. Woodford

2. Alfonso et al



است. بدیهی است که بهبود این موارد از جمله مهم‌ترین اهداف اقتصاددانان باشد. با وجودی اینکه در ایران تحقیقات قابل توجهی منظور بررسی اثر تکانه‌ها بر متغیرهای کلان اقتصادی انجام شده است، اما تعداد اندکی از این مطالعات در قالب مدل تعادل عمومی به موضوع پرداخته است. در این ارتباط، بررسی مالی نظری اثر تغییرات و تکانه‌های سیاست مالی بر متغیرهای اصلی اقتصاد کلان در قالب دو مکتب کینزی و کلاسیک انجام شده است. در این زمینه، مکتب کلاسیک بیان می‌کند که مخارج دولت موجب برون‌رانی سرمایه‌گذاران بخش خصوصی خواهد شد، از این رو اثری بر اقتصاد نخواهد داشت. در این دیدگاه، بیان شده است که با توجه به انعطاف‌پذیری قیمت‌ها و دستمزدها، سیاست‌های مالی تنها در مقطعی کوتاه بر بخش واقعی اقتصاد اثرگذار بوده و با تعدیل قیمت‌ها و دستمزدها این بخش به رنگ به تعادل اولیه خود باز می‌گردد، در نتیجه، عدم مداخله دولت در بازار، بهترین انتخاب خواهد بود. در مقابل، کینزی‌ها عنوان نمودند با توجه به وجود چسبندگی در قیمت‌ها، سیاست‌های مالی، ابزاری مناسب به منظور تثبیت اقتصادی حداقل در کوتاه مدت هستند. سیاست مالی به دلیل اینکه می‌تواند بر محیط کسب و کار اثر بگذارد، ابزاری مهم برای مدیریت اقتصاد به شمار می‌رود. در واقع، این نوع سیاست به مداخله دولت در روند بازار برای تغییر تولید اشاره می‌کند.

سیاست مالی برای دستیابی به ثبات اقتصادی می‌بایست رفتار ضدسیکلی داشته باشد. به این معنا که در رکود رفتار انبساطی و در رونق رفتار انقباضی داشته باشد. قواعد انعطاف‌پذیرتر و تمهیدات نهادی حمایتی می‌تواند به کاهش

تورش رفتار موافق سیکلی سیاست مالی کمک نماید.

با وجود اینکه در ایران تحقیقات درخور توجهی منظور بررسی اثر تکانه‌ها بر متغیرهای کلان اقتصادی انجام شده است، اما تعداد اندکی از این مطالعات از الگوهای تعادل عمومی پویای تصادفی استفاده کرده‌اند. در این کتاب شبیه‌سازی و بررسی اثرگذاری سیاستی دولت در شرایط تغییر ساختار اقتصاد، تأکید بر تکانه‌های مخارج دولت و مقایسه اثرگذاری بودجه‌های جاری و عمرانی دولت بر رفاه و همچنین امکان بررسی شوک‌های نفتی بر متغیرهای کلان اقتصادی نشود. بزرگ‌راه بر اساس الگوی تعادل عمومی پویای تصادفی پرداخته می‌شود. برپایان لازم است سپاسگزار کلیه عزیزانی باشم که با ارائه دیدگاه‌های ارزنده خود را به‌یمنی محض کتاب اثرگذار بودند. بر این اساس از آقایان دکتر محمدحسین مهدری، دکترا مصطفی سلیمی‌فر، دکتر حسین توکلیان و دکتر روزبه بالونژاد قدردانی می‌کنم.