



ناهمخوانی آماری

الگوی اقتصادسنجی کلان ایران

ویرایش ۴/۰۰

بیژن پیدآباد

هدف: تحلیل سناریوهای سیاستگذاری و پیش بینی های کلان اقتصادی

معادلات: ۱۴۰ معادله (۵۳ معادله استوکستیک و ۸۷ اتحاد)

پارامترها: ۲۰۴ پارامتر

متغیرها: «۲۲۴ متغیر» «۱۴۰ درونزا» «۸۴ از قبل تعیین شده» «۳۹ تأخیردار»

روش برآورد: حداقل مربعات معمولی

دوره زمانی: ۱۳۳۸-۱۳۷۴

الگوریتم شبیه سازی: Gauss-Sidel

پویایی: تأخیرات حداکثر تایک سال-استفاده از متغیرهای انباشته زمانی

ساختار ریاضی: معادلات برحسب پارامترها خطی و برحسب متغیرها هم

خطی و هم غیرخطی

بخشهای اصلی: خارجی، پولی، مالی، حقیقی، اسمی، قیمت-ارز-دستمزد، کار

ویژگیهای خاص

۱- تعادل و عدم تعادل

عدم تعادل	تقاضا	عرضه	تعادل
تراز جاری	واردات	صادرات	تجارت خارجی
تراز پرداختها	مصارف ارزی	منابع ارزی	ارزی
خالص بدهی بخش خصوصی	تقاضای پول	عرضه پول	پولی
کسری بودجه	هزینه دولت	درآمد دولت	مالی
تغییر در موجودی انبار +مغایرتهای آماری	تقاضای کالا و خدمت	عرضه کالا و خدمت	حقیقی
تغییر در موجودی انبار +مغایرتهای آماری	هزینه ملی	درآمد ملی	اسمی
بیکاری	تقاضای کار	عرضه کار	کار

۲- تعیین سیستماتیک قیمت

۳- بیان بخشهای حقیقی و اسمی با هم

۴- ایجاد ارتباط تعاریف مختلف در بودجه و حسابهای

ملی و حسابهای ارزی و ریالی

۵- برخورد غیرانفعالی با خطاها

۶- چندگانگی نرخهای ارز

۷- حساب ذخیره تعهدات ارزی

۸- دوگانگی نفتی

۹- ارتباط بخش پول و سرمایه گذاری

۱۰- عدم استفاده از نرخ بهره

۱۱- استفاده از تفاضلهای ساده و تعمیم یافته

۱۲- ارتباط بخش پول و بخش خارجی

۱۳- تابع تولید کاملاً جایگزین

۱۴- تعدیلات نرخ ارز در ارزشیابی دارائیهای خارجی

۱۵- فروش ارز در بازار غیررسمی ارز

مکانیزم عمل و ارتباط بخشها در الگو

۱ - خارجی

۲ - پول

۳ - دولت

۴ - حقیقی

۵ - اسمی

۶ - قیمت - ارز - دستمزد

۷ - کار

شرح معادلات

نحوه برخورد با اتحادهای ناصادق

۱- تصحیح مصنوعی آمار

۲- اضافه کردن جمله پسماند

۳- رگرسیون رابط بدون جمله اخلاص

۴- رگرسیون رابط با جمله اخلاص

ارتباط متغیرهای جریان و موجودی

۱- تبدیل متغیر جریان به موجودی

۲- تبدیل متغیر موجودی به جریان

ساختار زمانی و استفاده از متغیرهای تأخیری

تحوالات کیفی و استفاده از متغیرهای کیفی

برآورد سیستم معادلات

تشکیل الگو

شبیه سازی ۱۳۷۴ - ۱۳۳۸

شوکه‌های سیاستی

- ۱- قیمت نفت
- ۲- تولید نفت
- ۳- حساب سرمایه
- ۴- نرخ ارز رسمی
- ۵- نرخ ارز صادراتی
- ۶- قیمت مصرفی خارجی
- ۷- قیمت سیف کالاهای وارداتی
- ۸- حساب ذخیره تعهدات ارزی
- ۹- نرخ بهره بین بانکی لندن
- ۱۰- فروش ارز در بازار غیررسمی
- ۱۱- هزینه جاری دولت
- ۱۲- هزینه عمرانی دولت
- ۱۳- قیمت فرآورده های نفتی در داخل

پیش بینی

مشکلات ساختن الگوی کلان در ایران

مشکلات آماری

- حسابهای ملی

- دولت و بخش دولتی

- ارقام پولی

- ترازپرداختها

- نیروی انسانی

- شاخصهای قیمت

- نرخهای ارز

تحولات ساختاری

۱۳۳۸-۱۳۵۲ قبل از افزایش قیمت نفت

۱۳۵۳ شوک نفت

۱۳۵۳-۱۳۵۶ قبل از انقلاب و بعد از شوک نفت

۱۳۳۸-۱۳۵۷ ساختار قبل از انقلاب

۱۳۵۷ وقوع انقلاب

۱۳۵۹ شوک نفت

۱۳۵۸-۰۰۰۰ ساختار بعد از انقلاب

۱۳۵۹-۱۳۶۷ جنگ

۱۳۶۲-۰۰۰۰ بانکداری بدون ربا

۱۳۶۹-۱۳۷۲ استقراض خارجی

۱۳۶۸-۰۰۰۰ دوران بعد از جنگ

۱۳۷۲-۰۰۰۰ کاهش ارزش پول ملی

۱۳۷۰-۰۰۰۰ کاهش ارزش نرخ ارز صادراتی

۱۳۶۹-۱۳۷۳ سیاست های تعدیل

۱۳۶۹-۱۳۷۴ بازسازی

۱۳۷۵ سیاست های تثبیت