



# اثر نوسانات اقتصاد کلان بر توزیع درآمد خانوارهای ایرانی



دانشکده مدیریت و اقتصاد  
دانشگاه صنعتی شریف



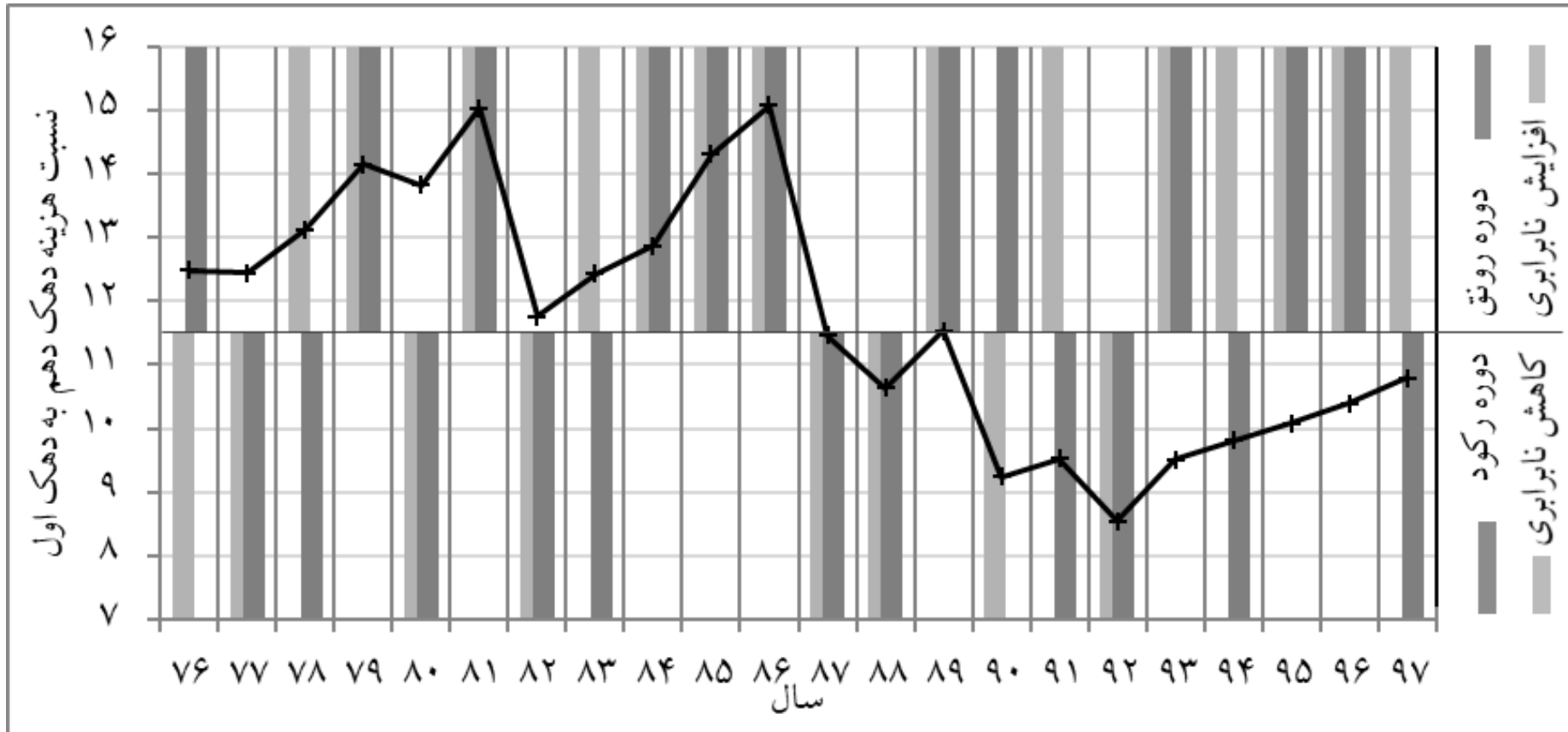
مسعود نیلی - منصور شاکریان

## فهرست

- مقدمه
- داده‌ها
- جنبه توصیفی: توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد ایران
- جنبه علی: مدل تجربی و نتایج
- نتیجه‌گیری و توصیه‌های سیاستی



- عدم توزیع یکنواخت آثار چرخه‌های تجاری بین خانوارها
- دوران رکود و کاهش نابرابری، دوران رونق و افزایش نابرابری



چرخه‌های تجاری		شاخص تطابق = ۰.۶۸	
رونق	رکود	کاهش نابرابری	وضعیت نابرابری
۲	۶	افزایش نابرابری	
۹	۵	کاهش نابرابری	



## • اقتصاد کلان

■ اطلاعات حساب‌های ملی ایران، بانک مرکزی

○ به قیمت‌های جاری و ثابت (۱۳۹۰) حد فاصل ۱۳۷۶ الی ۱۳۹۷

■ اطلاعات حساب‌های منطقه‌ای مرکز آمار ایران

○ به قیمت‌های جاری حد فاصل ۱۳۷۹ الی ۱۳۹۷

## • خانوار

■ طرح آمارگیری هزینه و درآمد خانوارهای شهری و روستایی مرکز آمار ایران حد فاصل ۱۳۷۶ الی ۱۳۹۷

○ داده‌های خام

○ خانوارهای شهری (۳۴۴,۱۸۲ خانوار) - خانوارهای روستایی (۳۶۴,۰۰۵ خانوار)



## • تقسیم‌بندی داده‌ها

■ تقسیم خانوارهای نمونه به گروه‌های مد نظر

○ تعدیل اندازه خانوار

$$\text{Size equivalence scale} = 1 + 0.7A + 0.5K$$

○ محاسبه هزینه‌ی سرانه تعدیل شده (کالای کم‌دوام و بادوام) هر خانوار

○ مرتب کردن خانوارها بر اساس مقدار هزینه‌ی سرانه تعدیل شده و تقسیم بندی

## • شاخص بهای کالاها و خدمات مصرفی

■ مرکز آمار، شاخص شهری و روستایی

■ ضریب تعدیل هر خانواده بر اساس سبد مصرفی اطلاعات هزینه‌ای خانوار (سال پایه ۱۳۹۰)

# مولفه‌های توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد ایران



- اندازه نسبی انحراف معیار بخش خرد روندزدایی شده هر گروه نسبت به انحراف معیار بخش کلان روندزدایی شده

$$\sigma_i = \frac{SD(Hlog(MicroSide)_{it})}{SD(Hlog(MacroSide)_t)}$$

- ضریب همبستگی بین بخش کلان روندزدایی شده و بخش خرد روندزدایی شده هر گروه

$$\rho_i = corr(Hlog(MicroSide)_{it} , Hlog(MacroSide)_t)$$

# توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد ایران



## • متغیرهای بخش کلان:

■ تولید ناخالص داخلی / تولید ناخالص داخلی بدون نفت / هزینه‌های مصرف نهایی بخش دولتی / ارزش افزوده بخش نفت / خدمات / صنایع

## • متغیر بخش خانوار:

■ درآمدهای خانوار:

○ درآمد ناخالص / درآمد خالص / درآمد حاصل از دستمزد / درآمد حاصل از سرمایه / درآمد حاصل از یارانه

■ هزینه‌های خانوار:

○ هزینه کل / هزینه‌های بادوام / سرمایه‌گذاری / هزینه‌های خوراکی / اجاره احتسابی مسکن / سایر هزینه‌های کم‌دوام

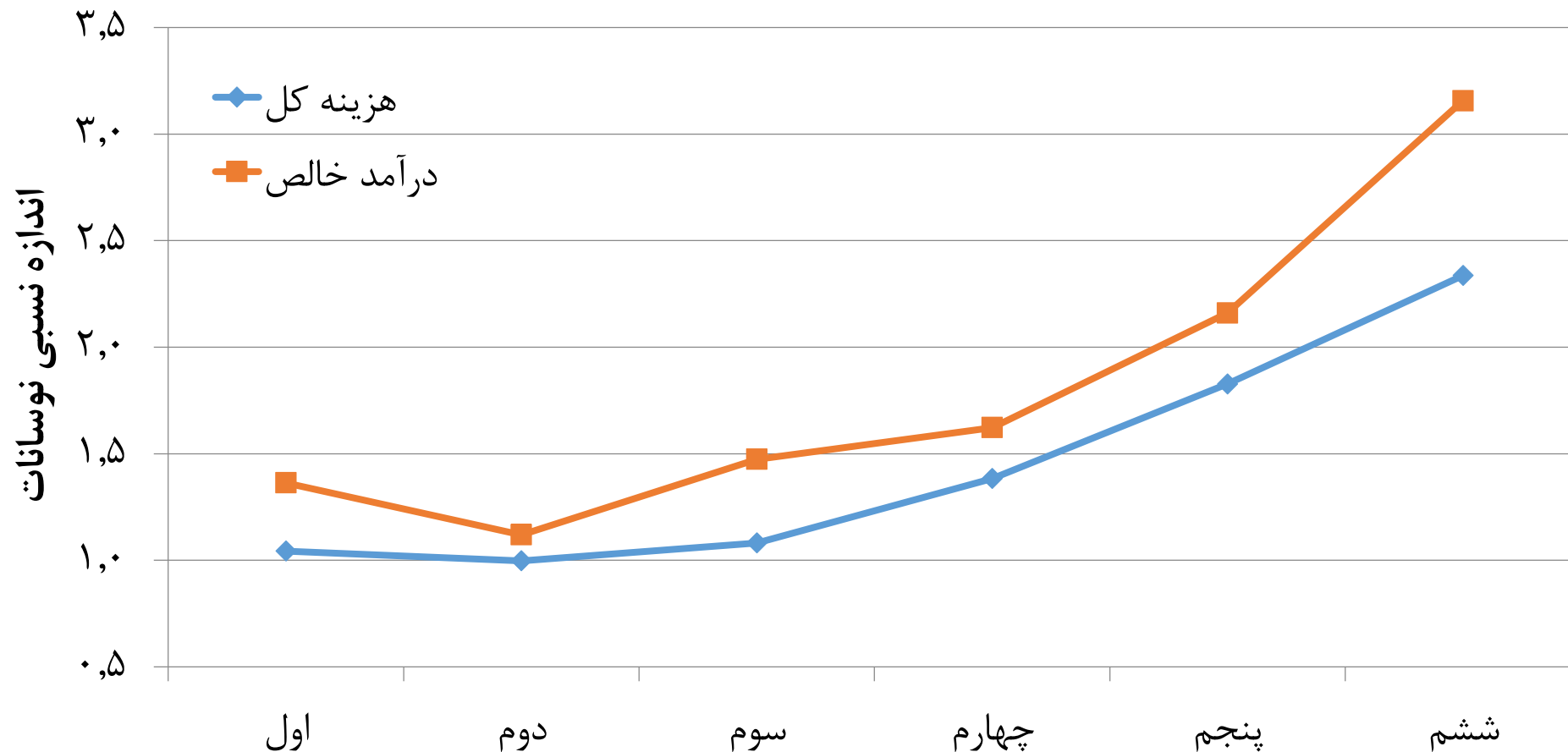
## • گروه‌های اقتصادی مورد بررسی:

■ ۴ پنجک اول (۰ تا ۸۰٪) + گروه پنجم (۸۰ تا ۹۵٪) + گروه ششم (۹۵ تا ۱۰۰٪)

# توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد ایران - اندازه نسبی نوسانات

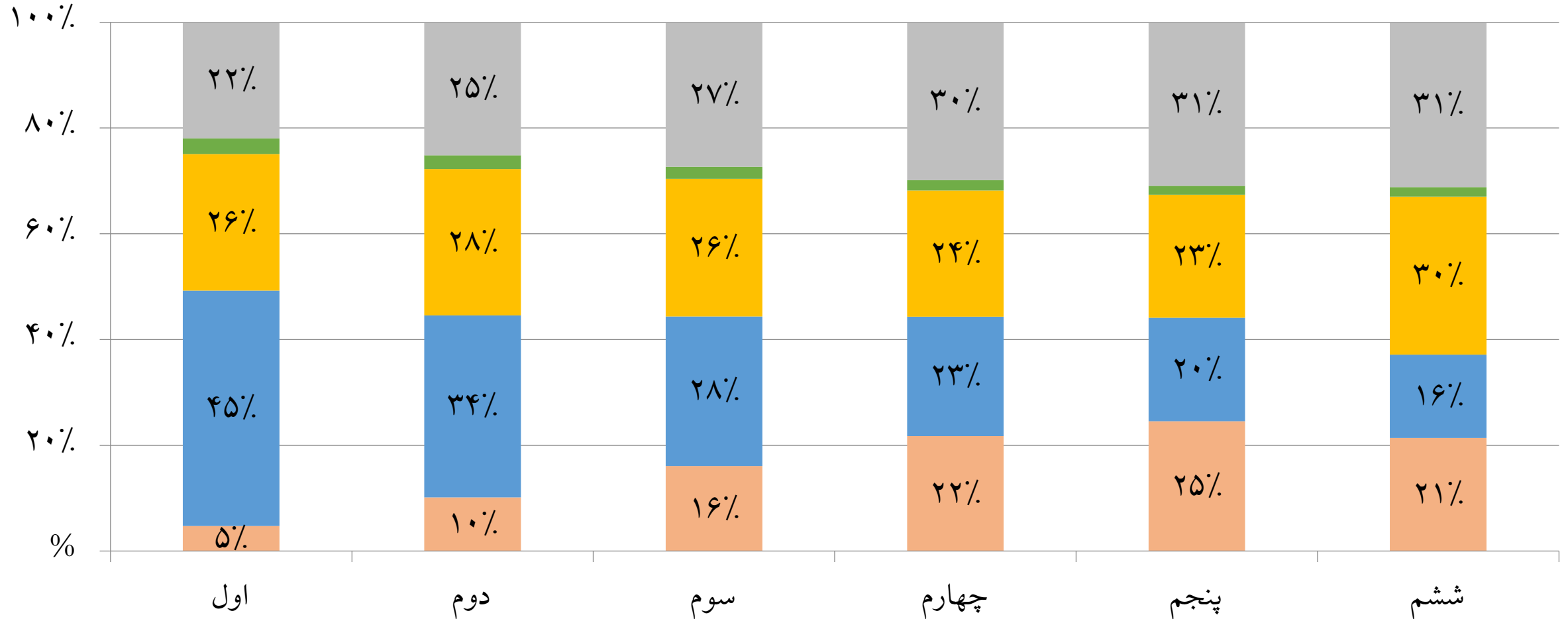


■ اندازه نسبی انحراف معیار درآمد و هزینه روندزدایی شده‌ی خانوار نسبت به انحراف معیار تولید ناخالص داخلی روندزدایی شده، داده‌های شهری سال‌های ۷۶ تا ۹۷.



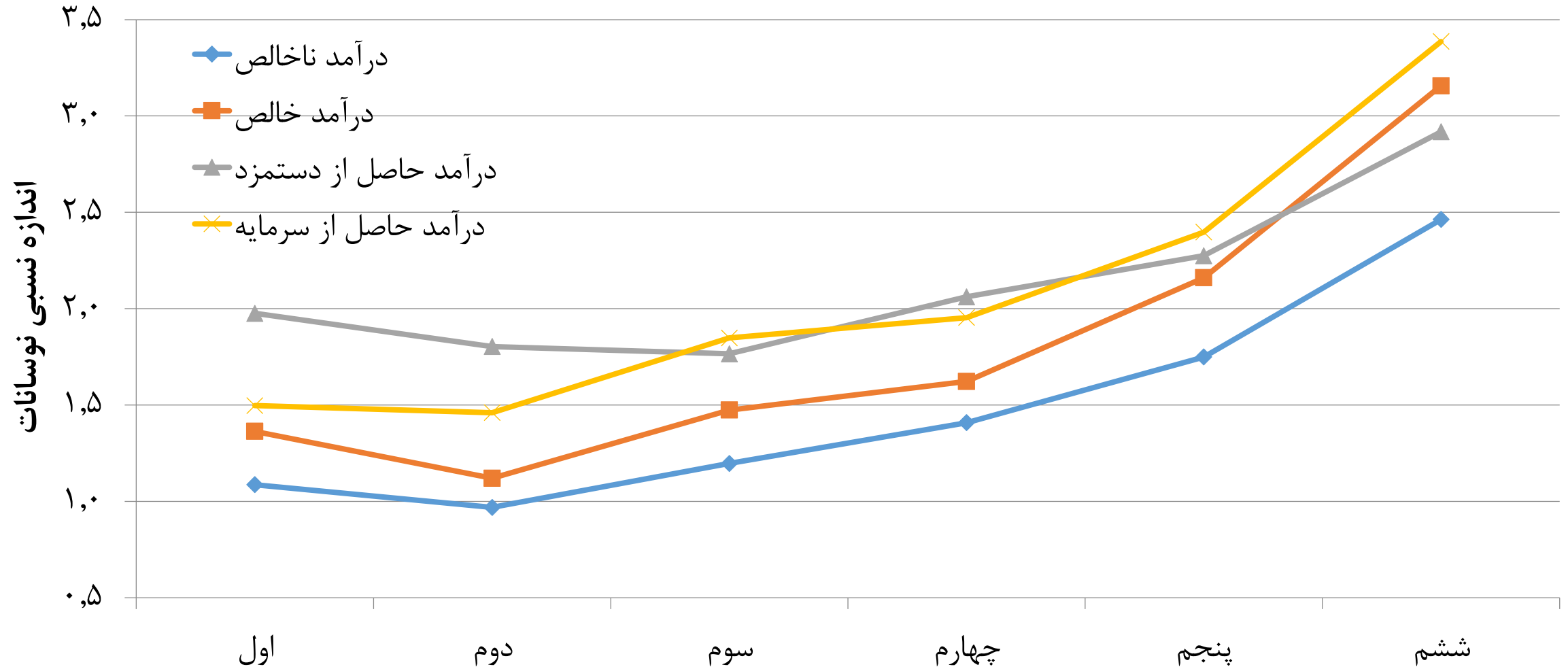


# میانگین وزن اجزاء درآمد خالص

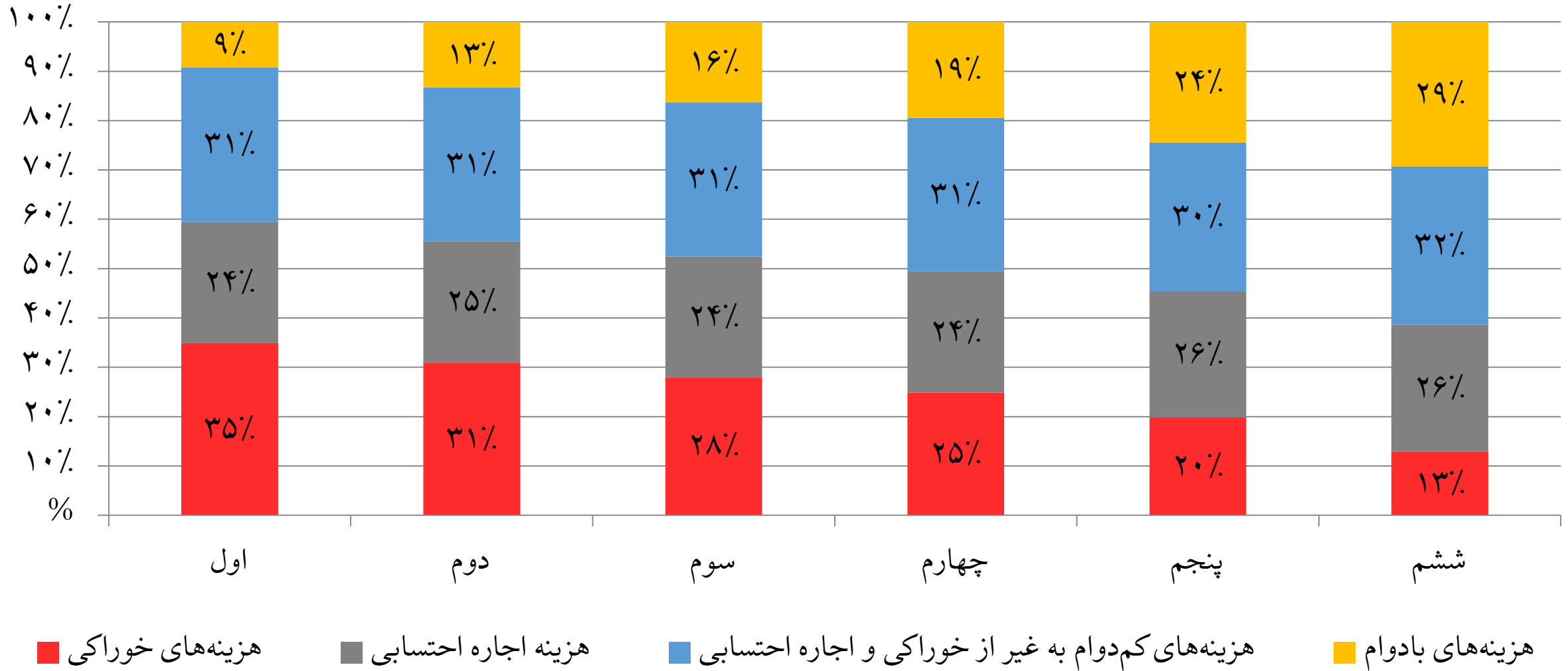


■ حقوق و دستمزد دولتی 
 ■ حقوق و دستمزد خصوصی 
 ■ درآمد غیردستمزدی غیر کشاورزی 
 ■ درآمد غیردستمزدی کشاورزی 
 ■ درآمد متفرقه

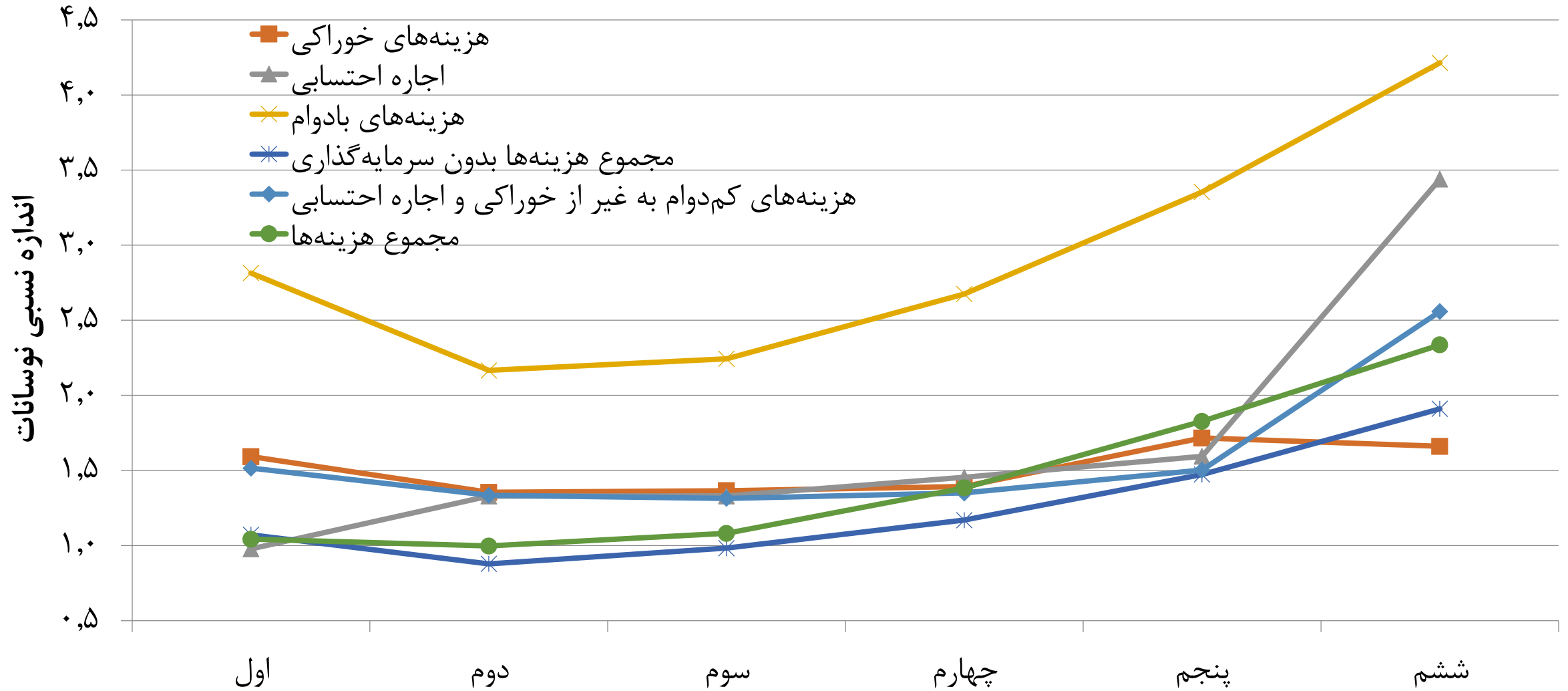
# اندازه نسبی نوسانات - درآمد



# میانگین وزن اجزاء هزینه



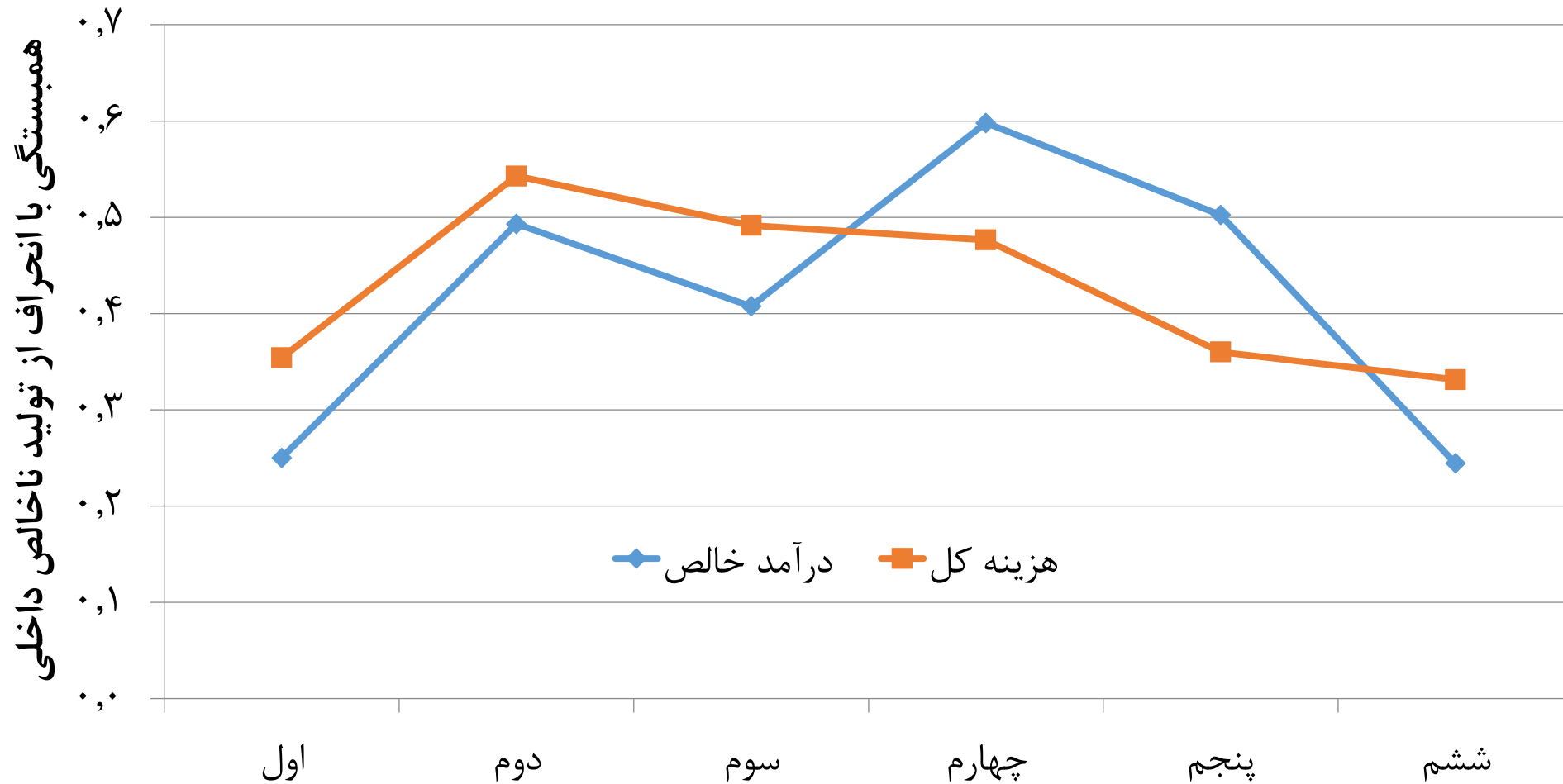
# اندازه نسبی نوسانات - هزینه



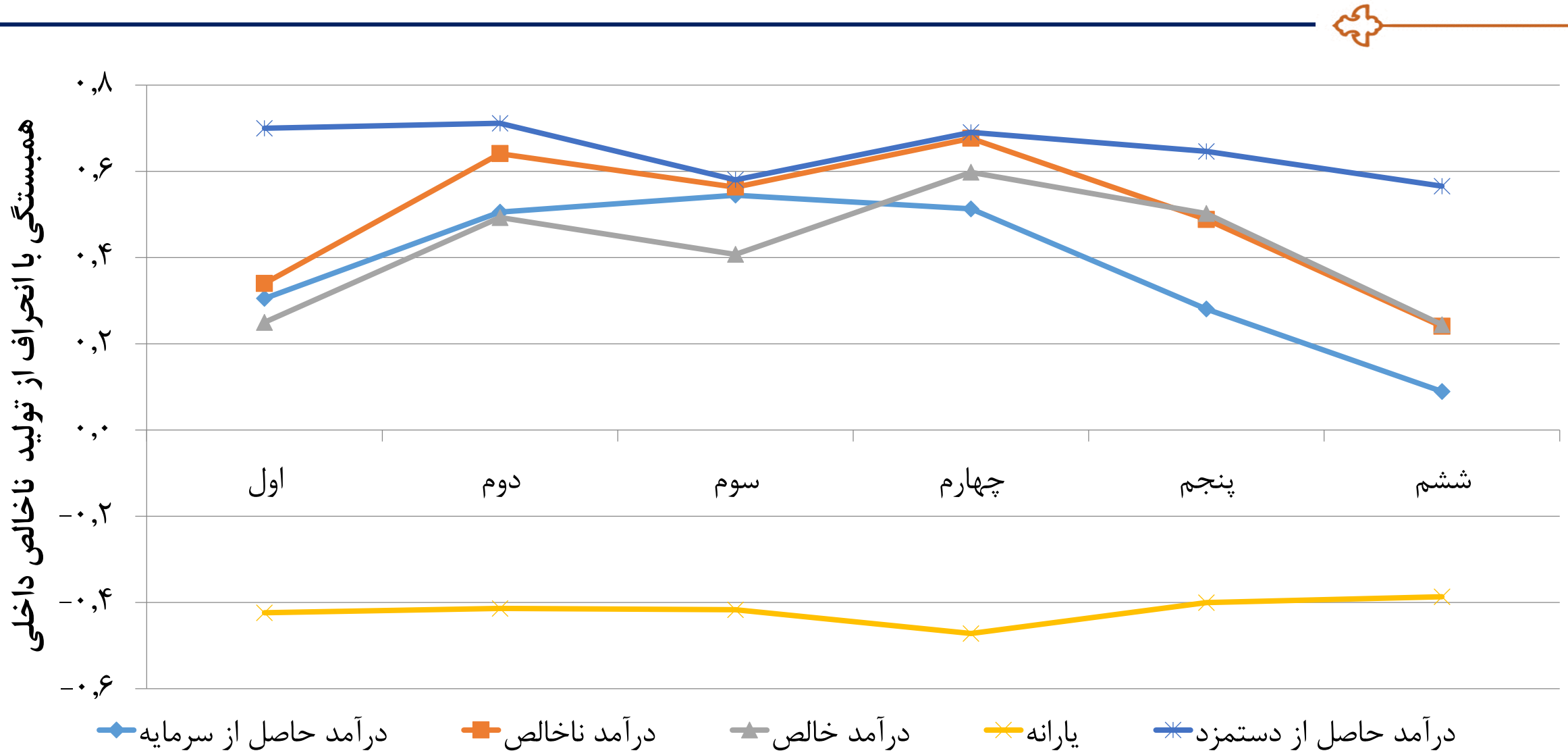
# توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد ایران - ضریب همبستگی



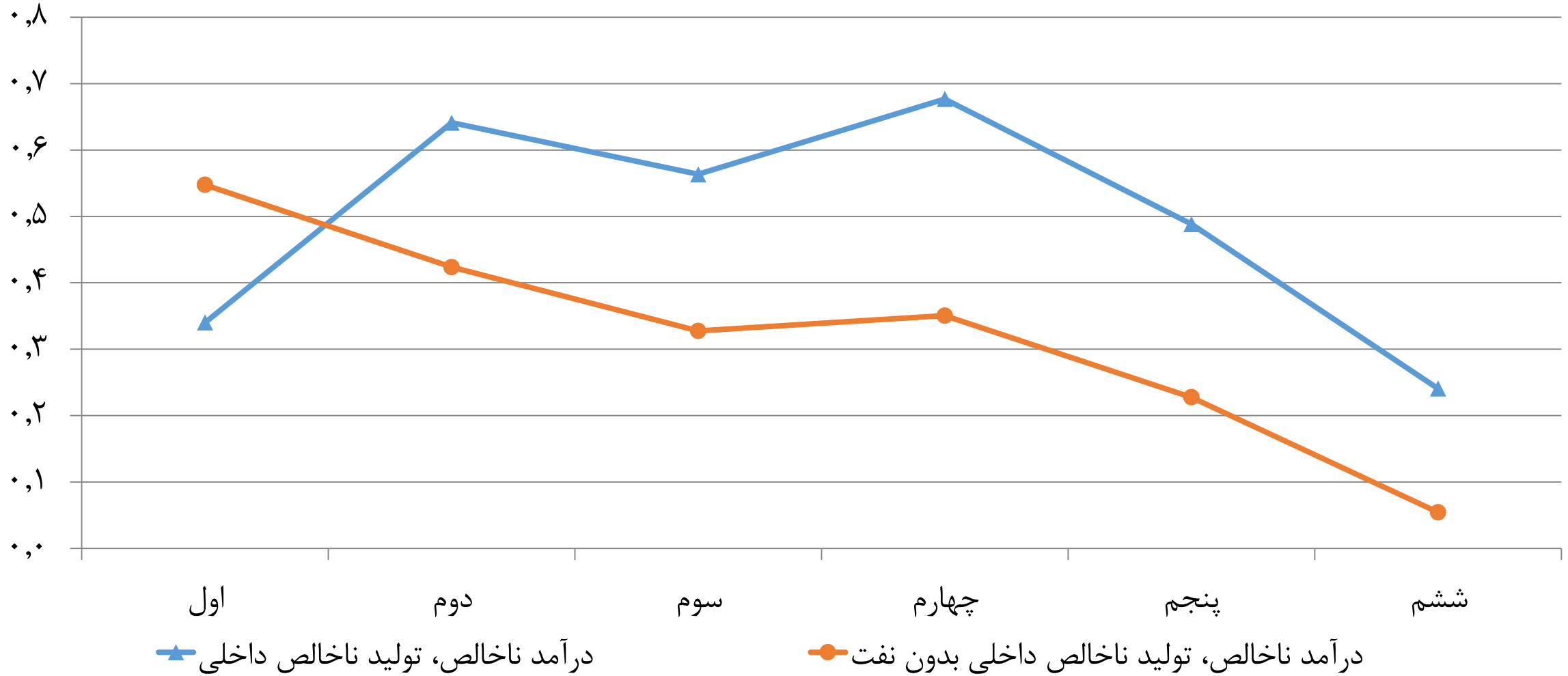
■ ضریب همبستگی بین متغیر بخش کلان رونزدایی شده و متغیر بخش خانوار شهری رونزدایی شده سال‌های ۷۶ تا ۹۷.



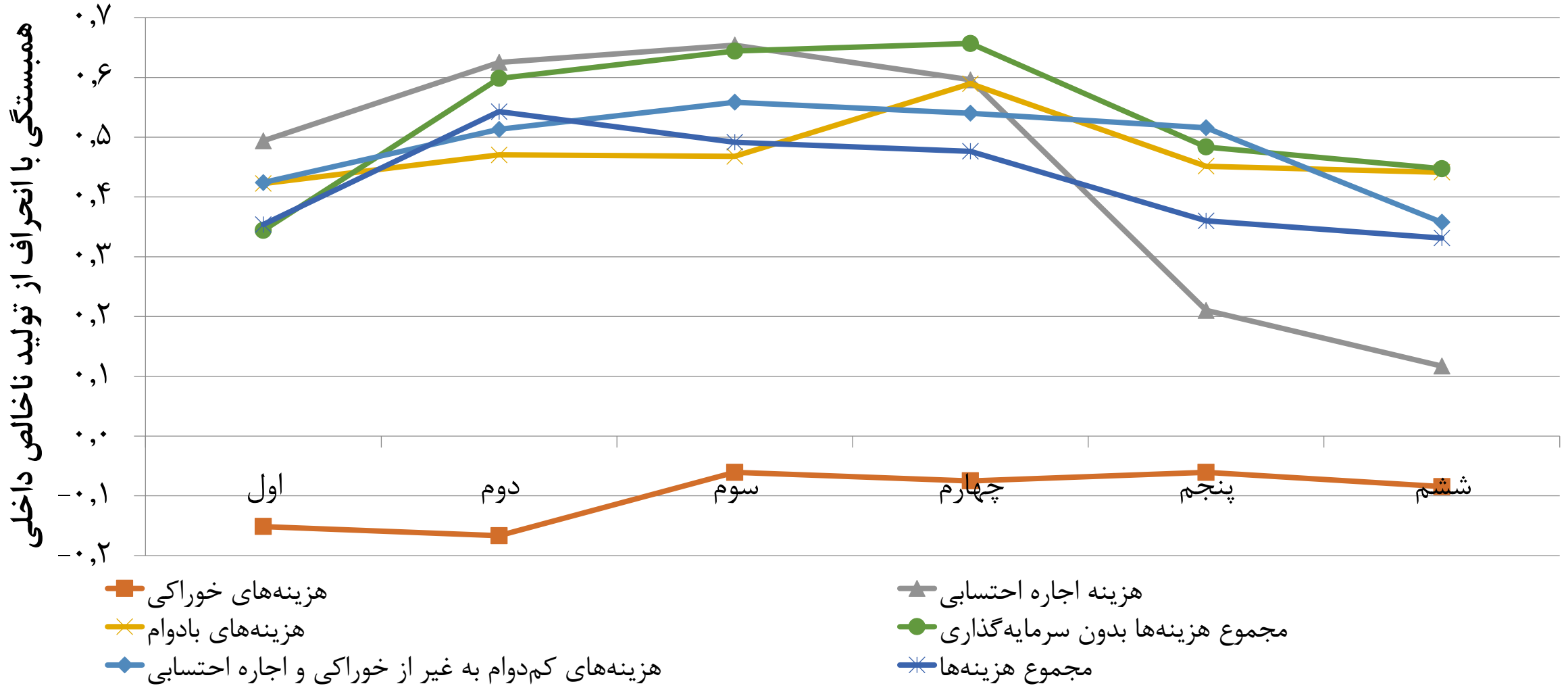
# ضریب همبستگی - درآمد



# ضریب همبستگی - درآمد

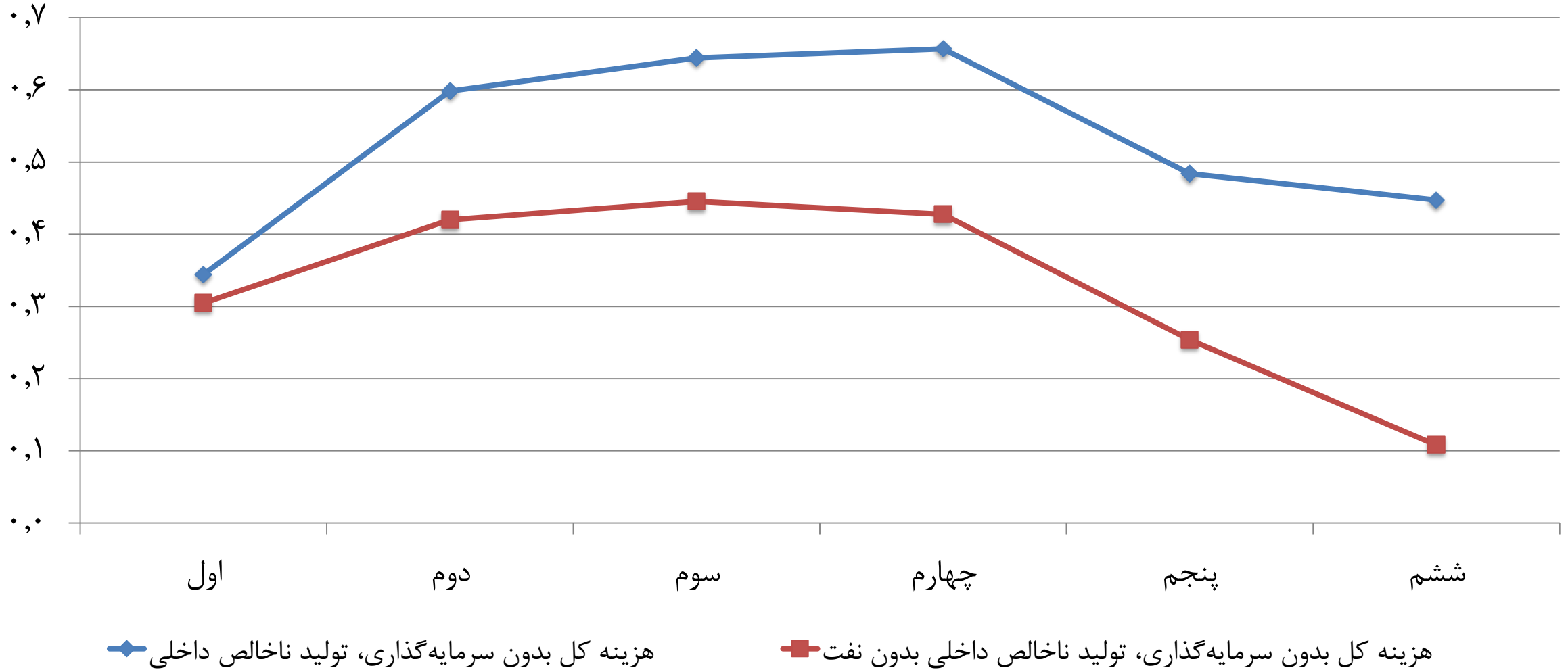


# ضریب همبستگی - هزینه





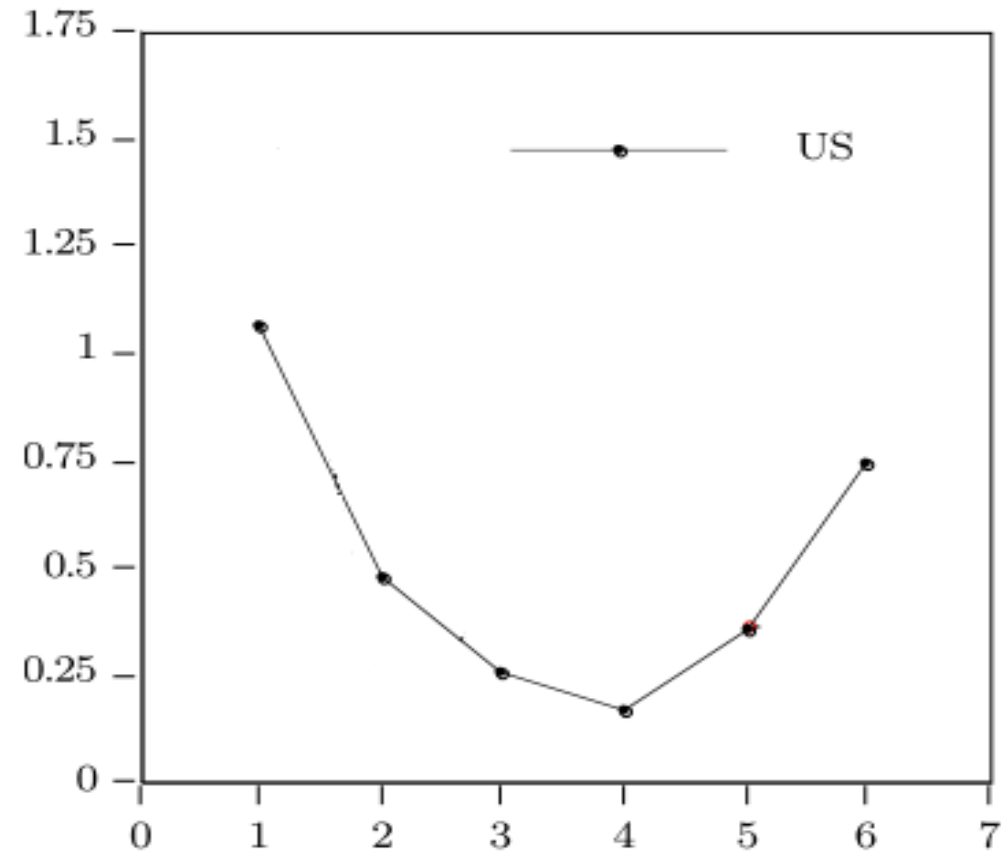
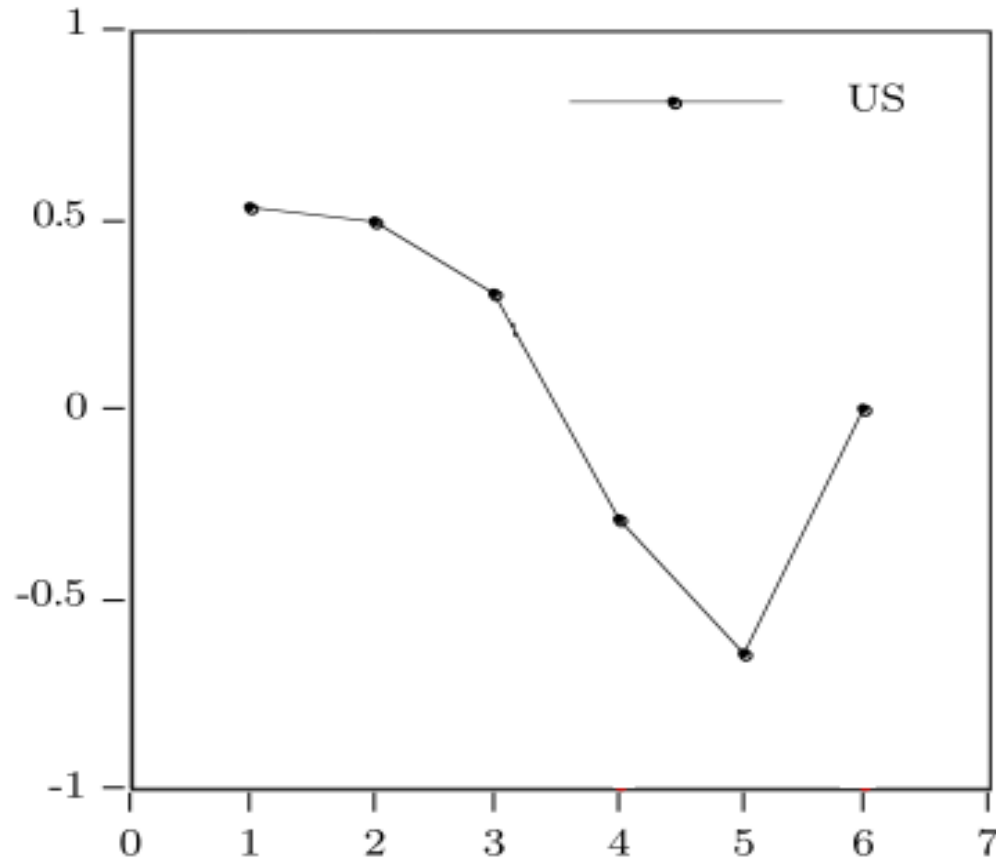
# ضریب همبستگی - هزینه



# توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد آمریکا



- کاستاندا و همکاران (۱۹۹۸)



# مدل تاثیر نوسانات بر نابرابری



- تصریح مدل بصورت روش حداقل مربعات معمولی دو مرحله‌ای
- داده‌های تابلویی، خانوارهای شهری و روستایی حد فاصل سال‌های ۱۳۷۹ تا ۱۳۹۷
- لحاظ اثرات ثابت سال و منطقه در سطح مناطق ده‌گانه کشور
- منشاء اصلی عمده‌ی نوسانات / نوسانات ناشی از درآمد صادرات نفت
- معادله اصلی

$$Ineq_{l,t} = \alpha_l + \delta_t + \alpha_l t + \beta(SGDP_l \hat{\times} Vol_t) + \rho X_{l,t} + \varepsilon_{l,t}$$

- تصریح مرحله اول

$$SGDP_l \times Vol_t = \alpha_l + \delta_t + \alpha_l t + \sum_{m=0}^1 \sum_{n=0}^1 (OS_t^m \times OP_t^n \times wcl) \theta_{mn} + \rho X_{l,t} + \mu_{l,t}$$

# تقسیم کشور به مناطق ده گانه



- افزایش تعداد نمونه در هر منطقه
- استان‌های هم‌جوار
- استان‌های مرزی
- استان‌های نفتی



# مدل تاثیر نوسانات بر نابرابری



Dependent variables	Loc.GDP Vol. to GDP Vol. ratio, 1390		Loc.GDP Vol. to GDP Vol. ratio, 1394	
	(1) Gini Coefficient	(2) P10/P1	(3) Gini Coefficient	(4) P10/P1
L.GDP Vol. Ratio × GDP Volatility	-0.577*** (0.197)	-14.911** (6.300)	-0.964*** (0.299)	-24.827*** (9.201)
Log. Population	-0.006 (0.301)	-1.154 (10.691)	-1.552*** (0.542)	-40.970** (16.340)
Share of Loc. GDP	-0.137* (0.071)	0.141 (2.201)	-0.140* (0.082)	0.059 (2.079)
Observations	190	190	190	190

# نتیجه‌گیری و توصیه‌های سیاستی



- هم‌زمانی اثرات سوء رفاهی نوسانات بخش حقیقی اقتصاد کلان و توزیع نامتوازن آن بین قشرهای مختلف اقتصادی از دو جنبه توصیفی و علی
- توزیع درآمد چرخه‌های تجاری اقتصاد ایران
  - نوسانات درآمد و هزینه گروه‌های پردرآمد بیشتر از سایر گروه‌هاست. این نوسانات با نوسانات تولید ناخالص داخلی هم‌زمان نیست. بیشترین هم‌زمانی نوسانات مربوط به قشر متوسط بوده است
  - ضریب همبستگی تمام گروه‌های اقتصادی هم‌دوران و قشر متوسط در رکودها بیشترین اثر منفی و در رونق‌ها بیشترین اثر مثبت را داشته است.
- مدل تاثیر نوسانات بر نابرابری
  - اثرگذاری نوسانات تولید ناخالص داخلی با منشا نفتی بر ضریب جینی و نابرابری مناطق ده‌گانه ایران منفی و در سطح یک درصد معنادار است

## نتیجه‌گیری و توصیه‌های سیاستی



- به دلیل نوسان بیشتر درآمد حاصل از سرمایه، سیاست‌های ثبات بازارهای مرتبط با سرمایه و تعمیق بخش مالی، می‌تواند آثار رفاهی قابل ملاحظه‌ای بین خانوارهای ایرانی داشته باشد.
- به دلیل نوسان بیشتر هزینه‌های کالاهای بادوام و اجاره احتسابی مسکن، ثبات بخش اسمی اقتصاد و کنترل درآمدهای حاصل از فروش نفت (وجود تورم بالا، نوسانات نرخ ارز و به‌خصوص اثرات مستقیم و غیرمستقیم بیماری هلندی) می‌تواند شوک‌های هزینه و درآمد خانوارهای ایرانی را کاهش دهد.
- با توجه به توزیع درآمد در اقتصاد ایران، تلاش برای ایجاد ثبات بخش حقیقی اقتصاد (کنترل شوک‌های بخش عرضه، کنترل درآمدهای حاصل از فروش نفت و به تبع آن بیماری هلندی، ایجاد روابط بلندمدت استراتژیک با سایر کشورها و کاستن از فشارهای بین‌المللی و تحریم‌ها)، کمک می‌کند بخش بزرگی از جمعیت کشور کمتر در معرض آسیب قرار بگیرند.

با تشکر از توجه شما

