





دانشکده علوم انسانی و اجتماعی

گروه اقتصاد

پایان نامه

برای اخذ درجه کارشناسی ارشد در رشته توسعه اقتصادی و برنامه ریزی

عنوان

اثرات نامتقارن شوک های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی ایران: رهیافت

مارکوف سویچینگ

استاد راهنما

دکتر سید علیرضا کازرونی

استاد مشاور

دکتر ایلناز ابراهیمی

پژوهشگر

نگین سادات مهاجرانی

مرداد ۱۳۹۰

تقدیم به

پدرم و مادرم

اسطوره های صبر، محبت، گذشت و شمع های فروزان زندگیم

خواهرانم و بردارم

به پاس همدلی و همایشان

همسرم

به پاس همراهی و کمک های بی دریغ اش

## تقدیر و تشکر

شکر و سپاس خدای را که به من نعمت آموختن عطا فرمود و هرچه دارم و می‌توانم داشته باشم از اوست . اینک که در سایه حضرت حق و به لطف ایزدمنان موفق به گذراندن این مرحله از زندگی‌ام شدم بر خود واجب می‌دانم که از تمامی عزیزان و سرورانی که مرا در انجام این کار یاری رساندند تقدیر و تشکر نمایم . ابتدا جای دارد صمیمانه ترین سپاس و تشکر خود را از محضر استاد ارجمند جناب آقای دکتر کازرونی و سرکار خانم دکتر ابراهیمی که راهنمایی و مشاوره این رساله را بر عهده داشتند تقدیم نمایم ، شایان ذکر است که در انجام این تحقیق همواره از راهنمایی های ارزنده این بزرگواران بهره فراوان برده‌ام و از خداوند متعال توفیق روزافزون ایشان را مسئلت می‌نمایم .

همچنین از جناب آقای دکتر برقی که زحمت داوری این پایاننامه را برعهده داشتند کمال تشکر و سپاسگزاری را دارم .

از سایر اساتید دوران تحصیلم که همواره از وجودشان بهره فراوان برده‌ام نیز سپاسگذارم .

در پایان از کلیه دوستانم به ویژه سرکار خانم فلورا خواجوی که در این مدت یاریگرم بودند کمال تشکر و قدردانی را دارم و از خداوند متعال زندگی باعزتی را برای تک تک این عزیزان مسئلت می‌نمایم .

نام خانوادگی : مهاجرانی

نام: نگین سادات

عنوان پایان‌نامه: اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی ایران: رهیافت مارکوف سوئچینگ

استاد راهنما: دکتر سید علیرضا کازرونی    استاد مشاور: دکتر ایلناز ابراهیمی

مقطع تحصیلی: کارشناسی ارشد    رشته: علوم اقتصادی    گرایش: توسعه اقتصادی و برنامه‌ریزی

دانشگاه: تبریز    دانشکده: علوم انسانی و اجتماعی

تعداد صفحات : ۱۰۳

واژه‌های کلیدی: چرخه‌های تجاری، شوک‌های مخارج دولتی، عدم تقارن، مدل مارکوف\_ سوئچینگ، رشد اقتصادی

طبقه بندی JEL: C32, C51, E32, E5

### چکیده

بررسی نقش و اثرات شوک‌های مخارج دولتی بر متغیرهای حقیقی اقتصاد، یکی از چالش برانگیزترین موضوعات در مباحث اقتصاد کلان می‌باشد که در این میان، برخی اقتصاددانان بر اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی بر متغیرهای اقتصادی از جمله تولید و در نتیجه آن بر رشد اقتصادی تأکید می‌کنند. لذا در این مطالعه با تکیه بر دیدگاه مکتب کینزی جدید، اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی ایران طی دوره ۱۳۵۱-۱۳۸۶ با استفاده از مدل مارکوف- سوئچینگ مورد بررسی قرار گرفته- است.

نتایج بدست آمده از بررسی اثرات شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت بر رشد اقتصادی طی دوره مطالعه نشان می‌دهد، هر دو شوک مثبت و منفی تأثیر منفی و معنی‌داری بر رشد اقتصادی دارند و از لحاظ آماری میان اثرات شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی تفاوت معنی‌داری وجود دارد به طوری‌که قدر مطلق اثرات شوک‌های منفی بر رشد اقتصادی در مقایسه با اثرات شوک مثبت بیشتر است.

## فصل اول: کلیات تحقیق

۱-۱- مقدمه.....	۲
۲-۱- بیان مسأله.....	۲
۳-۱- ضرورت و اهمیت موضوع.....	۳
۴-۱- اهداف تحقیق.....	۵
۵-۱- فرضیه تحقیق.....	۵
۶-۱- روش انجام تحقیق.....	۵
۷-۱- روش تجزیه و تحلیل داده‌ها و ابزارهای تحقیق.....	۶
۸-۱- جامعه آماری، دوره زمانی و روش گردآوری داده‌ها.....	۶
۹-۱- محدودیت‌های تحقیق.....	۶
۱۰-۱- سازماندهی تحقیق.....	۷

## فصل دوم: مروری بر ادبیات موضوع

۱-۲- مقدمه.....	۹
۲-۲- تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی.....	۹
۳-۲- دلایل عدم تقارن اثرات شوک‌های مخارج دولتی.....	۱۴
۳-۲-۱- عدم تقارن سمت عرضه در برابر شوک‌های مخارج دولت.....	۱۵
۳-۲-۲- عدم تقارن سمت تقاضا در برابر شوک‌های مخارج دولت.....	۲۰
۴-۲- پیشینه مطالعات تجربی.....	۲۱
۴-۲-۱- مطالعات خارجی.....	۲۱
الف) تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی.....	۲۲
ب) مطالعات مربوط به اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولت.....	۲۷
۴-۲-۲- مطالعات داخلی.....	۳۱
الف) تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی.....	۳۱
ب) مطالعات مربوط به اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولت.....	۳۸
۵-۲- جمع‌بندی فصل.....	۴۰

## فصل سوم: بررسی روند متغیرهای تحقیق

۴۱	۱-۳- مقدمه
۴۲	۲-۳- تحلیل روند تولید ناخالص داخلی ایران
۴۳	۳-۳- تحلیل روند تغییرات رشد اقتصادی در ایران
۴۵	۴-۳- تحلیل روند مخارج کل دولت و اجزاء آن
۴۵	۳-۴-۱- تحلیل روند مخارج کل دولت
۴۶	۳-۴-۲- تحلیل روند مخارج مصرفی دولت
۴۷	۳-۴-۳- تحلیل روند مخارج عمرانی دولت
۴۸	۳-۵- رابطه مخارج کل دولت و رشد اقتصادی
۴۹	۳-۶- بررسی رابطه سایر متغیرهای مدل با تولید ناخالص داخلی
۵۳	۳-۷- جمع بندی فصل

## فصل چهارم: روش شناسی تحقیق

۵۵	۴-۱- مقدمه
۵۵	۴-۲- مدل‌های سری زمانی غیرخطی
۵۷	۴-۲-۱- مدل اتورگرسیو آستانه‌ای (TAR)
۵۹	۴-۲-۲- مدل‌های انتقال ملایم (STAR)
۶۰	۴-۲-۳- مدل مارکوف- سوئچینگ اتورگرسیو
۶۴	۴-۳- استخراج چرخه‌های تجاری
۶۴	۴-۳-۱- تبیین چرخه‌های تجاری با استفاده از مدل مارکوف- سوئچینگ
۶۶	۴-۳-۲- مزیت استفاده از روش مارکوف- سوئچینگ نسبت به سایر روش‌ها
۶۷	۴-۴- مفهوم شوک‌های مخارج دولتی و استخراج شوک‌ها
۶۸	۴-۵- معرفی الگو و متغیرهای مدل‌ها
۷۱	۴-۶- تعریف عملیاتی متغیرهای تحقیق
۷۳	۴-۷- جمع بندی فصل

**فصل پنجم: برآورد مدل و تحلیل یافته های تحقیق**

۷۶	۱-۵- مقدمه .....
۷۶	۲-۵- آزمون پایایی متغیرها .....
۷۷	۳-۵- بررسی اثرات نامتقارن شوک های مثبت و منفی مخارج دولتی بر رشد .....
۷۸	۱-۳-۵- استخراج شوک های پولی مثبت و منفی با استفاده (VAR) .....
۷۸	۲-۳-۵- تعیین وقفه بهینه در مدل (VAR) .....
۸۰	۳-۳-۵- بررسی اثر شوک های بدست آمده بر رشد اقتصادی .....
۸۱	۴-۳-۵- تعیین وقفه بهینه برای مدل مارکوف- سوئچینگ .....
۸۷	۴-۵- نتایج استخراج چرخه های تجاری از روش مارکوف- سوئچینگ .....
۸۸	۵-۵- جمع بندی فصل .....

**فصل ششم: خلاصه و نتیجه گیری و ارائه توصیه های سیاستی**

۹۰	۱-۶- مقدمه .....
۹۱	۲-۶- مروری بر خطوط کلی پژوهش .....
۹۳	۳-۶- آزمون فرضیه تحقیق .....
۹۴	۴-۶- نتیجه گیری .....
۹۴	۵-۶- توصیه های سیاستی .....
۹۵	۶-۶- پیشنهاد برای پژوهش های آتی .....
۹۶	منابع و مآخذ .....
۱۰۱	ضمایم و پیوست ها .....
۱۰۲	الف) نتایج خروجی نرم افزار OxMetrics 6 .....
۱۰۳	ب) داده ها و اطلاعات آماری مورد استفاده در تحقیق .....



**الف) جداول**

- جدول (۱-۲)؛ مطالعات خارجی در مورد تأثیر مخارج دولت بر رشد اقتصادی ..... ۲۵
- جدول (۲-۲)؛ مطالعات خارجی در مورد اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی ..... ۳۰
- جدول (۳-۲)؛ مطالعات داخلی در مورد تأثیر مخارج دولت بر رشد اقتصادی ..... ۳۷
- جدول (۱-۴)؛ خلاصه حالت‌های مختلف مدل‌های MS-AR ..... ۶۳
- جدول (۱-۵)؛ وضعیت ایستایی متغیرها ..... ۷۷
- جدول (۲-۵)؛ نتایج تعیین مرتبه بهینه VAR ..... ۷۸
- جدول (۳-۵)؛ نتایج تخمین مدل (۱-۵) ..... ۷۹
- جدول (۴-۵)؛ نتایج آزمون LR ..... ۸۰
- جدول (۵-۵)؛ نتایج معیارهای آکائیک و شو ارتز در تعیین وقفه بهینه اتورگرسیو ..... ۸۱
- جدول (۶-۵)؛ نتایج معیارهای آکائیک و شو ارتز در تعیین وقفه بهینه شوک‌ها ..... ۸۱
- جدول (۷-۵)؛ تعیین تعداد رژیم‌ها با استفاده از معیار آکائیک ..... ۸۲
- جدول (۸-۵)؛ تخمین پارامترهای مدل ..... ۸۳
- جدول (۹-۵)؛ نتایج آزمون والد جهت بررسی تقارن اثرات شوک‌های مخارج دولتی ..... ۸۴
- جدول (۱۰-۵)؛ احتمال انتقال از یک رژیم به رژیم دیگر ..... ۸۵
- جدول (۱۱-۵)؛ ویژگی‌های هر یک از رژیم‌ها ..... ۸۶
- جدول (۱۲-۵)؛ چرخه‌های تجاری مستخرج از روش مارکوف - سوئچینگ ..... ۸۷

**ب) نمودارها**

- نمودار (۱-۲)؛ عدم تقارن اثرات شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولتی ..... ۱۹
- نمودار(۱-۳)؛ روند تغییرات تولید ناخالص داخلی به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶..... ۴۳
- نمودار(۲-۳)؛ متوسط نرخ رشد تولید ناخالص داخلی ایران..... ۴۳
- نمودار(۳-۳)؛ روند نرخ رشد تولید ناخالص داخلی ایران طی دوره ۱۳۵۱-۱۳۸۶..... ۴۵
- نمودار(۴-۳)؛ روند تغییرات مخارج کل دولت به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶..... ۴۶
- نمودار (۵-۳)؛ روند تغییرات مخارج مصرفی دولت به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶..... ۴۷
- نمودار(۶-۳)؛ روند تغییرات مخارج عمرانی دولت به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶..... ۴۷
- نمودار (۷-۳)؛ پراکنش مخارج کل دولت و رشد اقتصادی طی دوره ۱۳۵۱-۱۳۸۶..... ۴۸
- نمودار (۸-۳)؛ پراکنش بین لگاریتم سرمایه‌گذاری بخش خصوصی و لگاریتم تولید ناخالص داخلی..... ۴۹
- نمودار (۹-۳)؛ پراکنش بین لگاریتم مصرف بخش خصوصی و لگاریتم تولید ناخالص داخلی..... ۵۰
- نمودار (۱۰-۳)؛ پراکنش بین لگاریتم صادرات کل و لگاریتم تولید ناخالص داخلی..... ۵۱
- نمودار (۱۲-۳)؛ پراکنش بین لگاریتم صادرات غیرنفتی و لگاریتم تولید ناخالص داخلی..... ۵۱
- نمودار (۱۲-۳)؛ پراکنش بین لگاریتم صادرات نفتی و لگاریتم تولید ناخالص داخلی..... ۵۲
- نمودار (۱۳-۳)؛ پراکنش بین لگاریتم واردات کالا و لگاریتم تولید ناخالص داخلی..... ۵۳
- نمودار (۱-۴)؛ انتقال ملایم..... ۵۸
- نمودار (۲-۴)؛ انتقال سریع..... ۵۸
- نمودار (۱-۵)؛ وضعیت سه رژیم با میانگین رشد منفی و مثبت..... ۸۵
- نمودار (۲-۵)؛ وضعیت اجزاء اخلاص تخمین مدل MSM(3)-AR(1)..... ۸۵

فصل اول

کلیات تحقیق

### ۱-۱- مقدمه

دولت‌ها همواره از سیاست‌های مالی برای تنظیم اقتصاد استفاده می‌کنند که یکی از ابزارهای این سیاست، مخارج دولتی است. دولت‌ها برای رهایی یافتن از رکود و رونق بخشیدن به اقتصاد از سیاست مالی انبساطی و پس از آن، از سیاست مالی انقباضی برای ثبات اقتصادی استفاده می‌نمایند. اما برخی اقتصاددانان معتقدند که اثرات انبساطی و انقباضی مخارج دولت بر متغیرهای کلان اقتصادی یکسان نمی‌باشد. در ایران این دیدگاه که مبتنی بر اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی است، مورد بررسی قرار نگرفته است.

### ۱-۲- بیان مسأله

دستیابی به رشد اقتصادی بالا همواره به عنوان یکی از بنیادی‌ترین اهداف سیاست‌های کلان مورد توجه سیاست‌گذاران و برنامه‌ریزان اقتصادی قرار داشته است. در ادبیات اقتصادی، رشد به مفهوم گسترش در استفاده از ظرفیت‌های تولیدی و بطور دقیق‌تر براساس درصد افزایش سرانه تولید ملی واقعی در یک دوره بلند مدت بیان می‌شود. بنابراین دستیابی به رشد اقتصادی بالا مستلزم شناخت عوامل مؤثر بر آن است. در میان عوامل مؤثر بر رشد اقتصادی، مخارج دولتی و شوک‌های ناشی از آن، همواره یکی از موضوعات مهم در مباحث و تجزیه و تحلیل‌های اقتصادی بوده است.

هنگامی که کشوری دچار کسری بودجه است، شوک‌های انبساطی<sup>۱</sup> مخارج دولت احتمالاً باعث افزایش و در مقابل شوک‌های انقباضی<sup>۲</sup> مخارج دولت احتمالاً باعث کاهش استقراض شده‌اند. دیدگاه سنتی بیان می‌کند که بر اثر افزایش در مخارج دولت، تقاضای کل تحریک می‌شود و در اثر کاهش متناظر در مخارج، تقاضای کل به همان میزان کاهش می‌یابد. در حالی که مطالعات تجربی اخیر نشان از ارتباط نامتقارن بین مخارج دولت و تقاضای کل دارد، بدین گونه که اثر افزایش در مخارج دولت با اثر کاهش در آن متفاوت می‌باشد و این تفکر را که اثرات شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت بر متغیرهای کلان اقتصادی کاملاً یکسان بوده و سیاستگذاران قادر به استفاده یکسان از این ابزار مالی در جهت افزایش یا کاهش فعالیت‌های اقتصادی می‌باشند، را به چالش کشیده‌اند.

برخی از مطالعات از قبیل مطالعه‌ی کاندیل<sup>۳</sup> (۲۰۰۱)، به نامتقارن بودن اثر شوک‌های منفی و مثبت مخارج دولت بر تولید و در نتیجه رشد اقتصادی اشاره نموده‌اند. با فرض تصدیق اثرات نامتقارن مخارج دولت بر رشد اقتصادی، کارایی پیش‌بینی تمامی مدل‌های خطی اقتصاد مورد تردید قرار گرفته و شرایط مختلف اقتصادی، سیاست‌های مالی متفاوتی را طلب می‌کند. با توجه به مطالب ذکر شده و همچنین وجود شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت، در این تحقیق چگونگی اثرگذاری شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت بر رشد اقتصادی ایران طی دوره ۱۳۵۱-۱۳۸۶ مورد بررسی قرار می‌گیرد.

### ۳-۱- ضرورت و اهمیت موضوع

مهمترین اهداف سیاست‌های کلان اقتصادی، تثبیت نوسانات اقتصادی از جمله ثبات قیمت‌ها، رشد اقتصادی و سطح مطلوب اشتغال است.<sup>۴</sup> لذا ضرورت تحقیق در این امر نهفته است که

<sup>۱</sup>Expansionary Government Spending Shocks

<sup>۲</sup>Contractionary Government Spending Shocks

<sup>۳</sup>Kandil

<sup>۴</sup>سایت بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، بخش سیاست‌های پولی

مخارج دولتی به عنوان یکی از ابزارهای سیاست مالی، تا چه حد در رسیدن به اهداف ذکر شده کارا بوده است. به عبارت دیگر کاربرد این تحقیق می‌تواند راهنمای سیاست‌گذاران کشور در استفاده از سیاست مالی باشد.

در این تحقیق عدم تقارن اثرات شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی بدین صورت مطرح است که شدت تاثیرگذاری شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولتی بر رشد اقتصادی متفاوت است. عدم تقارن اثرات شوک‌های مخارج دولتی دلالت بر این دارد که ممکن است شوک‌های مثبت مخارج دولتی اثرات نسبتاً محدودتری بر رشد اقتصادی داشته باشد. با توجه به مطلب ذکر شده به نظر می‌رسد سیاست‌گذاران نمی‌توانند از این ابزار مالی در جهت افزایش یا کاهش فعالیت‌های اقتصادی به صورت یکسان استفاده کنند. مطالعه عدم تقارن شوک‌های مخارج دولتی می‌تواند نتایج بسیار ارزشمندی را در بررسی دقیق اثرات شوک‌های مخارج دولتی داشته باشد و از این جهت راهنمای مناسبی برای سیاست‌گذاری خواهد بود.

از طرف دیگر اکثر مطالعاتی که در زمینه‌ی مخارج دولتی و اثرات آن بر روی رشد اقتصادی صورت گرفته، با به کارگیری روش‌های خطی بوده و کمتر مطالعه‌ای در داخل کشور با استفاده از روش غیرخطی بوده است. از آنجا که روش‌های غیرخطی نسبت به روش‌های خطی دارای مزیت بوده و نتایج حاصل از آن‌ها مستندتر می‌باشد، ضروری به نظر می‌رسد که در داخل کشور مطالعه‌ای با استفاده از روش‌های غیرخطی صورت گیرد و اثرات شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی مورد بررسی قرار دهد تا بر اساس آن بتوان تحلیل‌های درستی از آثار شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی بدست آورد و نیز مسئولین اقتصادی کشور بتوانند با استناد به نتایج معتبر سیاست‌های مناسبی اتخاذ نمایند.

## ۴-۱- اهداف تحقیق

هدف اصلی این تحقیق بررسی تقارن و یا عدم تقارن اثرگذاری شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی در ایران می‌باشد. اما در کنار آن میزان و نحوه‌ی اثرگذاری شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

## ۵-۱- فرضیه تحقیق

اثر شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولتی بر رشد اقتصادی متقارن است.

## ۶-۱- روش تحقیق

این مطالعه از نوع تحقیقات کاربردی بوده و روش تحقیق از نوع تحلیلی-توصیفی می‌باشد. در مطالعه حاضر ابتدا با استفاده از روش کتابخانه‌ای آمار و اطلاعات و مباحث تئوریک و مطالعات تجربی جمع‌آوری شده و سپس با استفاده از روش‌های آمار توصیفی و تحلیلی، با در نظر گرفتن ملاحظات و شرایط اقتصاد ایران، مدل و الگوی تحلیلی مناسب اقتصادسنجی انتخاب خواهد شد. برای این منظور ابتدا شوک‌های مخارج دولتی مثبت و منفی توسط مدل اتو رگرسیون برداری (VAR) استخراج می‌شوند و نتایج حاصل از مدل VAR و همچنین با استفاده از مدل مارکوف\_سوئچینگ فرضیه تحقیق مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

عدم تقارن، در این تحقیق به صورت زیر مطرح است:

اثرات نامتقارن شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولتی بدان معناست که واکنش رشد اقتصادی در مقابل اثرات شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولتی یکسان نمی‌باشد.

## ۱-۷- روش تجزیه و تحلیل داده‌ها و ابزارهای تحقیق

در این مطالعه برای بررسی و تجزیه و تحلیل داده‌ها از مدل مارکوف\_ سوئچینگ و روش اتو رگرسیون برداری استفاده می‌شود. در این راستا و به منظور بررسی اهداف تحقیق، از نرم افزار- های Office2007، Eviews7 و OxMetrics 6 استفاده می‌شود.

## ۱-۸- جامعه آماری، دوره زمانی و روش گردآوری داده‌ها

در این تحقیق برای بررسی اثرات نامتقارن شوک‌های مختلف مخارج دولتی بر رشد اقتصادی از داده‌ها و اطلاعات سال‌های ۱۳۵۱-۱۳۸۶ اقتصاد ایران استفاده می‌شود. جامعه آماری مورد مطالعه، کشور ایران است که داده‌های سرمایه‌گذاری بخش خصوصی، مصرف بخش خصوصی، تولید ناخالص داخلی، صادرات کل، واردات کل، شاخص بهای کالا و خدمات مصرفی و مخارج کل دولت از بانک اطلاعات سریهای زمانی اقتصادی بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران<sup>۱</sup> تهیه شده است.

## ۱-۹- محدودیت‌های تحقیق

در مطالعاتی که به صورت سری زمانی در کشور انجام می‌گیرد، دسترسی به آمار و اطلاعات فصلی محدودیتی بزرگ به شمار می‌آید. این محدودیت در این تحقیق نیز به صورت نبود اطلاعات فصلی معتبر برای تولید ناخالص داخلی برای سال‌های قبل از ۱۳۶۷ و برای مخارج کل دولت برای سال‌های قبل از ۱۳۶۹ می‌باشد. بنابراین در مطالعه حاضر از اطلاعات سالانه استفاده شده است. محدودیت دیگر تحقیق، نبود منابع کافی درباره موضوع تحقیق و عدم بررسی شوک‌های مخارج دولت در مطالعات پیشین در ایران است.

<sup>۱</sup> www.tsd.cbi.ir



## ۱-۱۰- سازماندهی تحقیق

این مطالعه در شش فصل تنظیم شده است: پس از کلیات تحقیق مطرح شده در فصل اول، در فصل دوم ادبیات تحقیق شامل مبانی نظری و مطالعات انجام شده مرتبط با موضوع در داخل و خارج کشور مورد بررسی قرار گرفته است. در فصل سوم، روند متغیرهای تحقیق به صورت کیفی بررسی می‌شود. فصل چهارم به معرفی روش شناسی تحقیق و مباحث اقتصادسنجی مورد استفاده در تحقیق اختصاص یافته و در فصول پنجم و ششم نیز به ترتیب به برآورد مدل، تجزیه و تحلیل یافته‌ها، خلاصه و نتیجه‌گیری و ارائه پیشنهادهای تحقیق پرداخته می‌شود.

## فصل دوم

مروری بر ادبیات موضوع

## ۲-۱- مقدمه

با توجه به اینکه هدف اصلی این تحقیق، مطالعه اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی است و از آنجا که در مطالعات گذشته تأثیر نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی بر رشد اقتصادی مورد بررسی قرار نگرفته، از این رو مبانی نظری مستقلی در این زمینه وجود ندارد. لذا ابتدا تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی مورد بررسی قرار می‌گیرد و سپس در ادامه از لحاظ تئوریکی دلایل عدم تقارن اثرات شوک‌های مخارج دولتی بر متغیرهای اقتصادی مورد بحث قرار گرفته و در پایان به مرور برخی مطالعات انجام شده در داخل و خارج از کشور در مورد تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی و اثرات نامتقارن شوک‌های مخارج دولتی بر متغیرهای اقتصادی پرداخته می‌شود.

## ۲-۲- تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی

تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی یکی از موضوعات مهم در مباحث و تجزیه و تحلیل‌های اقتصادی است. اهمیت موضوع از بعد نظری در این می‌باشد که چگونه دولت می‌تواند شرایط با ثباتی را برای رشد اقتصادی ایجاد کند. در مورد تأثیر مخارج دولتی بر رشد اقتصادی باور عمومی بر این است که افزایش مخارج دولتی در زمینه توسعه انسانی و زیر ساخت‌ها می‌تواند به افزایش رشد اقتصادی کمک نماید.

در متون اقتصادی، دو دیدگاه در مورد تأثیر افزایش مخارج دولت بر رشد اقتصادی مطرح است: در دیدگاه اول فرض می‌شود که افزایش مخارج دولتی می‌تواند برای رشد اقتصادی زیان آور

باشد. از ادله این ادعا این است که در اغلب اوقات عملکرد دولت با عدم کارایی همراه است. دلیل دیگر این است که تأمین مالی مخارج دولتی که می‌تواند از طریق منابع خارجی و داخلی صورت گیرد، هزینه‌ها و اثرات نامطلوبی را بر سیستم اقتصادی تحمیل می‌کند که این خود مانع رشد اقتصادی می‌شود.

دیدگاه دوم، در فرآیند رشد اقتصادی نقشی مهمی را به دولت نسبت می‌دهد و اذعان دارد که افزایش نقش دولت در اقتصاد تأثیری مثبت بر رشد اقتصادی دارد. یکی از دلایل این ادعا نقش مهم دولت در زمینه هماهنگ کردن منافع عمومی و خصوصی می‌باشد که می‌تواند بواسطه آن امکانات را برای رشد اقتصادی فراهم نماید (قالی<sup>۱</sup>، ۲۰۰۳، ص ۱۵). در این ارتباط می‌توان به نظریه‌های زیر اشاره کرد.

#### \* نظریه هابس

نظریه ارتباط بین مخارج دولت و رشد اقتصادی، از جمله مباحث پیچیده اقتصادی قلمداد می‌شود که برای نخستین بار در سال ۱۶۵۱ توسط توماس هابس<sup>۲</sup> مطرح گردید. هابس زندگی اجتماعی بدون حضور دولت را نامطبوع، مشکل، ناقص و غیرانسانی می‌داند و اعتقاد دارد نظم، مقررات، کالاها و خدماتی که از سوی دولت عرضه می‌شود، جزء اجتناب ناپذیر زندگی اجتماعی انسان است. بر اساس نظریه‌های هابس، عملکرد دولت در زمینه‌هایی نظیر حمایت از حقوق مالکیت، تشویق کننده رشد اقتصادی است. از زاویه دیگر، حقوق مالکیت، مشوق تنظیم و اجرای قراردادها بوده و همچنین با برقراری نظام پولی پایدار به نوبه خود زمینه عملکرد باثبات پولی را فراهم می‌سازد. دولت می‌تواند رشد اقتصادی را از طریق توسعه امور زیربنایی تقویت نماید. علاوه بر آن، وجود کالاهایی به مانند کالاهای عمومی به دلیل ویژگی رایگان بودن، از جمله موارد شکست بازار تلقی

<sup>1</sup> Ghali

<sup>2</sup> Thomas Hobbs