

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشکده اقتصاد مدیریت و علوم اداری

گروه مدیریت صنعتی

پایان نامه دوره کارشناسی ارشد MBA - اقتصاد مدیریت

عنوان:

تأثیر بحران‌های مالی بر تولید با توجه به کشورهای

عضو اوپک

استاد راهنما:

دکتر اسمعیل ابونوری

استاد مشاور:

دکتر غلامحسین گل ارضی

پژوهشگر:

مرضیه گرجی

مهرماه ۱۳۹۳

از استاد گرامی و محترم جناب آقای دکتر اسمعیل ابونوری بسیار سپاسگذارم چرا که بدون راهنمایی های ایشان تاسین پیمان نامه

بسیار مشکل می نمود.

از استاد گرامی و محترم جناب آقای دکتر غلامحسین گل ارضی که مشاوره این تحقیق را بر عهده داشتند، کمال تشکر و قدردانی را

دارم.

از اساتید محترم داور، که زحمت داوری این پایان نامه را بر عهده گرفتند، کمال تشکر و قدردانی را دارم.

از خانواده عزیزم که در تمامی مراحل زندگی صادقانه مرا حمایت نموده اند، تشکر و قدردانی می نمایم.

در پایان از دوست عزیزم، سرکار خانم دنیاغریب پور که همواره در سختی ها مرا یاری نموده اند، تشکر می نمایم.

چکیده:

در این پژوهش سعی شده است تا اثر بحران‌های مالی بر تولید با توجه به کشورهای عضو اوپک در بازه‌ی زمانی ۱۹۷۰-۲۰۱۳ مورد مطالعه قرار گیرد. برای این منظور با توجه به مطالعات تجربی پیشین مدل تابع تولید با استفاده از داده‌های پانل برآورد شده است. نتایج به دست آمده از این پژوهش گویای آن است که بحران آمریکای لاتین بر تولید کشورهای عضو اوپک تاثیر منفی داشته است، اما بین بحران مالی کشورهای جنوب‌شرق آسیا و تولید کشورهای عضو اوپک تاثیر معناداری مشاهده نشده است. بحران مالی ۲۰۰۸ تاثیر مثبت اندکی بر تولید کشورهای عضو اوپک داشته است. علاوه بر این، طبق معادله‌ی تولید کشش تولیدی سرمایه و نیروی کار، به ترتیب ۰/۱۵ و ۱/۰۷ تولید ناخالص داخلی برآورد شده است.

کلمات کلیدی: بحران مالی، تولید، اوپک

فهرست مطالب

صفحه	عنوان مطالب
	فصل اول: کلیات تحقیق
۱-۱- ۲	مقدمه
۲-۱- ۴	بیان مسئله
۳-۱- ۶	اهمیت و ضرورت پژوهش
۴-۱- ۷	تعریف عملیاتی واژگان
۵-۱- ۹	فرضیه‌های پژوهش
۶-۱- ۹	قلمرو زمانی و مکانی پژوهش
۷-۱- ۹	روش انجام تحقیق
۸-۱- ۱۰	ساختار پایان نامه
	فصل دوم: پیشینه تحقیق
۱-۲- ۱۳	مقدمه
۲-۲- ۱۴	بحران‌های مالی
۱-۲-۲- ۱۵	بحران آمریکای لاتین
۲-۲-۲- ۱۷	بحران جنوب شرق آسیا
۳-۲-۲- ۲۰	بحران مالی ۲۰۰۸
۳-۲- ۲۳	تعریف تولید
۴-۲- ۲۵	بخش واقعی اقتصاد
۵-۲- ۲۵	درجه باز بودن اقتصاد

- ۲-۶- تأثیر بحران مالی بر بخش واقعی اقتصاد ۲۶
- ۲-۷- عوامل تأثیرگذار بر تولید در طول بحران‌ها ۳۰
- ۲-۸- پیامدهای بحران بر اقتصاد ایران ۳۳
- ۲-۹- مرور ادبیات از دیدگاه تجربی ۳۴
- ۲-۹-۱- مطالعات خارجی ۳۴
- ۲-۹-۲- مطالعات داخلی ۴۵
- ۲-۱۰- جمع‌بندی فصل ۴۸
- فصل سوم: روش تحقیق
- ۳-۱- مقدمه ۵۱
- ۳-۲- روش تحقیق ۵۱
- ۳-۳- جامعه آماری ۵۲
- ۳-۴- روش گردآوری داده‌ها ۵۳
- ۳-۵- معرفی متغیرها و چگونگی محاسبه آنها ۵۴
- ۳-۶- تصریح مدل ۵۷
- ۳-۷- آزمون‌های ریشه واحد و مانایی ۵۹
- ۳-۷-۱- آزمون دیکی فولر و دیکی فولر تعمیم‌یافته ۶۱
- ۳-۷-۲- هم‌انباشتگی ۶۳
- ۳-۸- بررسی فروض کلاسیک ۶۳
- ۳-۸-۱- بررسی هم‌خطی ۶۴
- ۳-۸-۲- خود همبستگی ۶۵

۹-۳- پانل کلاسیک ۶۶

۱۰-۳- جمع بندی ۶۹

فصل چهارم: تجزیه و تحلیل اطلاعات

۱-۴- مقدمه ۷۱

۲-۴- تحلیل داده‌ها ۷۱

۱-۲-۴- نتایج آزمون مانایی متغیرها ۷۶

۲-۲-۴- تحلیل هم‌انباشتگی متغیرهای برآوردی ۷۷

۳-۴- بررسی فروض کلاسیک ۷۸

۱-۳-۴- نرمال بودن جملات پسماند ۷۸

۲-۳-۴- عدم وجود هم‌خطی ۷۹

۴-۴- تخمین مدل پانل دیتا و تفسیر نتایج ۸۰

۵-۴- جمع بندی فصل ۹۰

فصل پنجم: نتیجه‌گیری و پیشنهادات

۱-۵- مقدمه ۹۲

۲-۵- مروری بر خطوط کلی پژوهش ۹۲

۳-۵- بحث و نتیجه‌گیری ۹۵

۴-۵- پیشنهادات ۹۸

۱-۴-۵- پیشنهادات کاربردی ۹۸

۲-۴-۵- پیشنهادات برای تحقیقات آتی ۹۹

۹۹ محدودیت‌های تحقیق
۱۰۰ فهرست منابع فارسی
۱۰۲ فهرست منابع لاتین

فهرست جدول‌ها

- ۴۴ (۲-۲): مطالعات خارجی
- ۴۸ (۳-۲): مطالعات داخلی
- ۷۴ (۱-۴): آمار توصیفی داده‌های سرمایه، تولید، درجه باز بودن اقتصادی، جمعیت
- ۷۴ (۲-۴): آمار توصیفی داده‌های تولید ناخالص داخلی
- ۷۵ (۳-۴): آمار توصیفی داده‌های سرمایه
- ۷۵ (۴-۴): آمار توصیفی داده‌های نیروی کار
- ۷۶ (۵-۴): آمار توصیفی داده‌های درجه باز بودن اقتصادی
- ۷۷ (۶-۴): نتیجه آزمون‌های مانایی
- ۷۸ (۷-۴): نتایج آزمون هم‌انباشتگی یوهانسون
- ۸۰ (۸-۴): بررسی همبستگی بین متغیرهای مدل
- ۸۱ (۹-۴): آزمون اف لیمر
- ۸۱ (۱۰-۴): تخمین پانل دیتا
- ۸۲ (۱۱-۴): خصوصیات اصلی تخمین پانل دیتا
- ۸۳ (۱۲-۴): تخمین پانل دیتا
- ۸۳ (۱۳-۴): خصوصیات اصلی تخمین پانل دیتا
- ۸۴ (۹-۴): محاسبه کشش‌های تولید
- ۸۴ (۱۰-۴): بررسی بحران‌ها

فهرست اشکال و نمودارها

- ۱۸ (۱-۲): تغییرات در تولید ناخالص داخلی کره، مالزی، تایلند
- ۶۰ (۱-۴): مقایسه تولید ناخالص داخلی کشورهای مورد مطالعه
- ۷۹ (۲-۴): آزمون نرمال بودن پسماندهای مدل برآوردی
- ۸۷ (۳-۴): مقایسه مقدار واقعی و برازش شده برای الجزایر
- ۸۷ (۴-۴): مقایسه مقدار واقعی و برازش شده برای اکوادور
- ۸۸ (۵-۴): مقایسه مقدار واقعی و برازش شده برای ایران
- ۸۸ (۶-۴): مقایسه مقدار واقعی و برازش شده برای نیجریه
- ۸۹ (۷-۴): مقایسه مقدار واقعی و برازش شده برای عربستان
- ۸۹ (۸-۴): مقایسه مقدار واقعی و برازش شده برای ونزوئلا
- ۹۴ (۱-۵): نوسانات قیمت نفت

فصل اول

کلیات تحقیق

۱-۱) مقدمه

بحران‌های مالی، یکی از پدیده‌های رایج در اقتصاد داخلی و جهانی به شمار می‌آیند. بروز بحران‌ها، هزینه‌های اقتصادی زیادی را برای کشورها به دنبال دارد. دولت‌ها در راستای کاهش هزینه‌های اقتصادی بحران‌های مالی و نیز جلوگیری از سرایت بحران و مقابله با آن، با توجه به شرایط اقتصادی خود، سیاست‌هایی به کار می‌گیرند. بحران‌های مالی گذشته تجارب ارزنده‌ای را در مقابله با بحران‌ها از طریق به کارگیری سیاست‌های مختلف اقتصادی، برای کشورها به دنبال داشته است (فرزین‌وش و دیگران، ۱۳۸۹). این بحران‌ها از عوامل بسیار مهم برای کشیدن اقتصاد یک کشور به عرصه رکود می‌باشد. به دنبال بحران‌های مالی مشکلات بسیاری برای یک کشور از جمله بیکاری، کاهش تولید، مشکلات روانی و ... رخ می‌دهد؛ کشورها با گرفتن سیاست‌های مختلف اقتصادی سعی در کاهش پیامدهای وقوع بحران‌ها دارند. گرفتن سیاست‌های مناسب اقتصادی مستلزم شناخت بحران‌ها و میزان تاثیرگذاری این بحران‌ها بر شرایط اقتصادی کشورها می‌باشد. بنابراین کنکاش در پیامدهای وقوع بحران‌ها و میزان و چگونگی تاثیر این بحران‌ها بر بخش واقعی اقتصاد از جمله ضروریات است.

در قرن‌های گذشته اقتصاد دنیا بحران‌های مالی متعددی را تجربه کرده است، از جمله بحران کشورهای آمریکای جنوبی و بحران جنوب شرق آسیا، بحران مالی اخیر نیز که در تابستان ۲۰۰۷ در آمریکا رخ داده و به تدریج اروپا و سایر کشورها را در بر گرفت از نظر دامنه بزرگی و تاثیرات بلندمدت آن بر روی بخش واقعی اقتصاد بی‌سابقه است. بحران کنونی بر بسیاری از کشورهای در حال توسعه جهان نیز تاثیر گذاشته؛ البته با توجه به شبکه ارتباط متقابل اقتصادی و مالی در سطح جهانی، بروز چنین وضعیتی غیر منتظره نبوده است.

ایران نیز از پیامدهای بحران‌های مالی در امان نبوده است. از مهم‌ترین عوامل تأثیر بحران مالی بر اقتصاد ایران می‌توان به کاهش قیمت نفت، نرخ تورم دو رقمی، کاهش قیمت‌های جهانی که به زیان صادرکنندگان و تولیدکنندگان داخلی در برابر سیل واردات اجناس مصرفی خارجی است؛ اشاره کرد. این موارد را اگر به مشکلات دیرینه‌ی صنعت و تولید در ایران و افزایش واردات در سال‌های گذشته به مدد افزایش بی‌سابقه‌ی قیمت نفت و ناتوانی بخش تولید و صنعت در جذب دلارهای نفتی و جایگزینی بخش واردات به جای آن اضافه کنیم، می‌توان انتظار داشت که تولید و صنعت از رشد بالایی برخوردار نباشد و بیکاری در حوزه صنعت تشدید شود، که این امر به نوبه خود در افزایش بیکاری در بخش خدمات هم تاثیرگذار خواهد بود (درگی، ۱۳۹۱).

علاوه بر تاثیرات ذکر شده در ایران بازارهای انرژی جهان نیز، به دلیل کمبود تقاضا، با مشکلات عمده‌ایی از جانب کاهش قیمت انرژی روبه‌رو شده‌اند. نفت نیز، که مهم‌ترین منبع تأمین مالی و درآمدی کشور است، از این پیامدها جا نمانده و کاهش قیمت هر بشکه نفت از ۱۴۷ دلار در ژانویه به کمتر از ۴۰ دلار در پایان سال ۲۰۰۸ نشانگر تاثیر عمیق بحران بر اقتصاد نفتی است (حسن‌زاده، علی، کیانوند، مهران، ۱۳۸۸). از آنجا که بخش عمده‌ایی از بودجه دولتی کشورهای عضو اوپک از درآمدهای سهل الوصول نفت تأمین می‌شود، تاثیر این بحران‌ها بر بخش واقعی

اقتصاد کشورهای عضو اوپک دور از انتظار نیست. البته میزان تاثیرگذاری و تاثیرپذیری این کشورها به یک میزان نبوده است. با ملاحظه آثار منفی و کوتاه مدت بحران‌های مالی بر بخش واقعی اقتصادها، نتیجه گرفته شده است که صادرات‌گرایی، مساعد بودن شرایط محیطی داخل و خارج از کشور و درجه توسعه یا تعمیق مالی، تاثیر معنادار و ماندگاری بر رویه تعدیل بخش واقعی اقتصادها بعد از بحران‌های مالی داشته‌اند (نادری، مرتضی، ۱۳۸۲).

به دلیل آنکه ظاهراً کشور ما پیوند ضعیفی با اقتصاد جهانی دارد، از لحاظ اقتصادی نسبت به کشورهای صنعتی و اقتصادهای نوظهور، کمتر تحت تأثیر بحران قرار گرفته است. اما کاهش قیمت نفت و رشد اقتصاد جهانی بر قیمت و حجم صادرات، سرمایه‌گذاری و منابع مالی و پولی کشورمان تأثیر گذاشته و خواهد گذاشت. لذا مطالعه دقیق پیامدهای بحران‌های مالی جهانی و شناسایی فرصت‌ها و تهدیدهای ناشی از بحران مزبور برای اقتصاد ایران از نهایت اهمیت برخوردار است.

۱-۲) بیان مسئله

بحران مالی جهانی در سال ۲۰۰۸ با ابعاد وسیع اثرگذاری بر اقتصاد، موجب گردیده است که مطالعه بحران‌های گذشته، مانند بحران بدهی‌ها در آمریکای لاتین در سال‌های دهه ۱۹۸۰ و بحران مالی شرق آسیا در سال‌های ۱۹۹۷ تا ۱۹۹۸ مورد توجه خاص محافل علمی و اجرایی جهان قرار بگیرد. اثرات سوء ناشی از بحران‌های مالی به اشکال مختلفی از قبیل نرخ تورم بالا، کاهش رشد اقتصادی، رکود گسترده و کاهش اشتغال، کسری تراز پرداخت‌ها و غیره ظهور نموده و در سطح بین‌المللی به سایر کشورها نیز تسری می‌یابد (حسن زاده و کیانوند، ۱۳۸۸). بر این اساس بحران از کانال‌های مختلف بر اقتصاد اثر می‌گذارد انتظار می‌رود تأثیرات بحران‌های مالی بر روی

بخش واقعی اقتصاد برای چندین سال ادامه داشته باشد، لذا نیازمند مطالعه اثر بحران‌های مالی بر اقتصاد کشورها در بلندمدت هستیم.

برای بررسی وضعیت اقتصادی یک جامعه می‌توان شاخص‌های کلان اقتصادی از جمله تولید ناخالص داخلی^۱، تولید ناخالص ملی^۲، نرخ بیکاری، نرخ تورم، نرخ ارز، شاخص بازار سهام را مورد مطالعه قرار داد. مسلماً بحران‌های مالی بر روی این شاخص‌های کلان اقتصادی بی‌تأثیر نبوده است. از میان این شاخص‌ها می‌توان تولید ناخالص داخلی را به عنوان مهم‌ترین، جذاب‌ترین و در عین حال بهترین سری اقتصادی برای مطالعه وضعیت عمومی اقتصاد به حساب آورد. تولید ناخالص داخلی معمولاً به عنوان بهترین شاخص برای سنجش موقعیت اقتصادی یک کشور، شناخته می‌شود. تولید ناخالص داخلی یکی از شاخص‌های مهم آماری در سطح کلان، یک وسیله موثر برای شناخت و فهم افراد از وضعیت اقتصادی یک کشور و یک روش موثر و علمی برای بررسی سیاست‌های اقتصادی کشور می‌باشد. تولید ناخالص داخلی یکی از رایج‌ترین راه‌ها برای سنجش تولید یک کشور می‌باشد (کامینسکی، رینهارت، ۱۹۹۹).

برای اندازه‌گیری میزان تولید طیف وسیعی از انواع توابع تولید معرفی شده که هر کدام به نوعی در کارهای تجربی مورد استفاده قرار گرفته است. با این حال در زمینه تابع تولید در اقتصاد کلان عمدتاً سه نوع تابع تولید لئونتیف، کاب-داگلاس و تا حدودی ترانسندنتال به کار گرفته شده است. از این میان تابع تولید کاب-داگلاس به واسطه ویژگی امکان جانشینی بین عوامل در جریان تولید و مناسب بودن فرم تابعی آن بیشتر مورد توجه قرار گرفته است (سلطانی، غلامرضا، ۱۳۸۳).

شواهد نشان می‌دهد بحران‌های مالی در دهه‌های گذشته با کاهش چشم‌گیر تولید همراه بوده‌اند. برای مثال در بحران ۲۰۰۲ آرژانتین، تولید ۱۱ درصد افت پیدا کرد. در سایر موارد،

¹ Gross Domestic Product

² Gross National Product

اقتصادها در بحران‌ها الگوهای متفاوتی را از خود نشان داده‌اند؛ برای مثال بحران‌های مالی ۱۹۸۵ کلمبیا، ۱۹۹۴ چین، ۱۹۸۴، ۱۹۸۷ ونزوئلا و ۱۹۹۳ مجارستان با افزایش تولید همراه بوده‌اند (گوپتا، ۲۰۰۷). در طول سال‌های گذشته، در واقع، امکان اینکه بحران‌های مالی با کاهش و زیان در تولید مرتبط باشد به طور گسترده‌ایی در محافل سیاسی و مطبوعات مالی مورد بحث قرار گرفته است، تا جاییکه دولتمردان برخی کشورها در مفروضاتشان در رابطه با تولید بالقوه به صورت کاهشی تجدیدنظر کرده‌اند. برای مثال در بودجه ۲۰۰۹، خزانه داری بریتانیا کاهش ثابت تولید را معادل با ۵ درصد تولید ناخالص داخلی تخمین زده است (بناتی، لوکا، ۲۰۱۰).

با توجه به تأثیر مشاهده شده بحران‌های مالی بر اقتصاد جهانی از جمله تولید، در این پژوهش سعی شده است اثر سه بحران مالی بزرگ آمریکای لاتین، جنوب شرق آسیا و بحران ۲۰۰۸ آمریکا بر تولید با استفاده از داده‌های تولید ناخالص داخلی و تابع تولید کاپ-داگلاس برآورد گردد.

۱-۳) اهمیت و ضرورت پژوهش

در میان مسائل مورد ابتلای جامعه، موضوعی که امروزه از اهمیت ویژه‌ایی برخوردار می‌باشد، مسائل اقتصادی است. اقتصاد برای جوامع از اهمیت بالایی برخوردار است، زیرا استقلال جامعه و شکوه و عظمت آن در مقابل جوامع دیگر بستگی به حل مشکلات و رفع کمبودهای اقتصادی آن جامعه دارد. از آنجایی که بحران‌های مالی از طریق کانال‌های مختلف بر اقتصاد اثر می‌گذارند و این تأثیرات تا مدت طولانی بر اقتصاد کشورها مشاهده می‌شود، لازم است اثرات بحران‌های مالی بر اقتصاد کشورها مورد مطالعه قرار گیرد. مطالعه و شناسایی بحران‌های رخ داده و اثراتی که از خود به جای گذاشته‌اند سیاست‌گذاران را در شناسایی بحران‌های آتی و مقابله با آن‌ها یاری می‌نماید.

بعد از بحران مالی شدید همراه با رکود و در حالیکه کشورها در حال بهبود اوضاع اقتصادی‌شان هستند، بحران وام و اعتبار می‌تواند به تولید زیان وارد کند. محدودیت‌های مالی فراگیر می‌تواند تولید فعلی را از طریق محدود کردن دسترسی شرکت‌ها به سرمایه در گردش محدود کند، و هم چنین تولیدات آینده را با محدود کردن هزینه‌های سرمایه‌گذاری و سهام سرمایه‌های آتی کاهش دهد (بلیندر، ۲۰۰۷). نادیده گرفتن چگونگی تاثیرپذیری تولید از بحران‌های مالی می‌تواند منجر به قضاوت نادرست در رابطه با اندازه شکاف تولید و، همان طور که در گذشته اتفاق افتاده است، تصمیمات نادرست سیاستی شود (ارفاندیز و دیگران، ۲۰۰۰).

بنابراین در این پژوهش با توجه به اثرگذاری بحران‌های مالی بر بخش واقعی اقتصاد سعی شده است سه بحران مالی بزرگ کشورهای آمریکای لاتین، جنوب‌شرق آسیا و بحران ۲۰۰۸ آمریکا مورد مطالعه و بررسی قرار گیرد. با توجه به عضویت کشورمان در اوپک و اهمیت و نقشی که اوضاع اقتصادی کشورهای عضو اوپک در تصمیم‌گیری‌های سیاسی کشورمان ایفا می‌کند، اثر بحران‌های مالی بر تولید در ایران به همراه برخی کشورهای عضو اوپک مورد مطالعه قرار می‌گیرد. از آنجایی که دستیابی به اطلاعات صحیح اقتصادی لازمه تصمیم‌گیری‌های درست در سطح کلان کشورها می‌باشد، امید است دستاوردهای این پژوهش مورد استفاده تصمیم‌گیران کلان اقتصادی و دانش‌پژوهان آتی قرار گیرد.

۱-۴) تعریف عملیاتی واژگان

بحران مالی: بحران مالی اصطلاحی نسبتاً جامع است که وجود بحران در بسیاری از متغیرهای بخش مالی را دربرمی‌گیرد. بحران تراز پرداخت‌ها، بحران پول رایج، بحران بدهی‌های مالی، ورشکستگی بانک‌ها، بحران ذخایر بین‌المللی، و بحران بازار سهام، از جمله مواردی هستند

که اصطلاح بحران مالی همگی آن‌ها را در بر می‌گیرد. برخی از این موارد با یکدیگر ارتباط دارند (احمدزاده و دیگران، ۱۳۹۱). برای مثال، یک بحران تراز پرداخت‌ها ممکن است که بحران ذخایر و بحران پول رایج را به همراه داشته باشد، و یا یک بحران پول رایج می‌تواند منجر به بحران بانکی شود (پارک و لی، ۲۰۰۱). از این رو، کاربرد عامیانه اصطلاح بحران مالی برای هر یک از این موارد دور از واقعیت نیست. بحران‌های مالی به دلیل آثار منفی که بر عملکرد بخش واقعی اقتصاد دارند، دارای اهمیت می‌باشند.

اوپک: سازمان کشورهای صادرکننده نفت با نام اختصاری اوپک یک کارتل بین‌المللی نفتی است که متشکل از کشورهای الجزایر، ایران، عراق، کویت، لیبی و نیجریه، قطر، عربستان سعودی، امارات متحده عربی، اکوادور، آنگولا و ونزوئلا می‌باشد که با هدف محافظت از منافع کشورهای صادر کننده نفت ایجاد شده است.

تولید ناخالص داخلی: تولید ناخالص داخلی که به اختصار GDP نامیده می‌شود معیاری برای اندازه‌گیری تولید است. تولید ناخالص داخلی عبارت است از کل ارزش تولیدات کالاها و خدمات در یک کشور به قیمت بازار طی دوره یک زمان به خصوص (معمولاً یک سال) است. تولید ناخالص داخلی یکی از شیوه‌های اندازه‌گیری برای تولیدات و درآمد ملی یک کشور است. تولید ناخالص داخلی، ارزش اضافی کالاها و خدماتی را اندازه‌گیری می‌کند که در یک دوره زمانی در اقتصاد یک کشور تولید شده و برای مصارف نهایی در داخل کشور یا برای صادرات به خارج از کشور در دسترس قرار گرفته‌اند (مرکز آمار ایران).

تابع تولید کاپ-داگلاس: از میان توابع تولید، کاپ-داگلاس گسترده‌ترین تابع تولید به کار رفته در کار تجربی است تابع بدین صورت نشان داده می‌شود:

$$Q=AL^{\alpha}K^{\beta} \quad (۱-۱)$$

که Q محصول و L و K به ترتیب نهاده‌های نیروی کار و سرمایه هستند. A ، α و β پارامترهای مثبتی هستند که در هر حالتی به وسیله داده‌ها معین می‌گردند. پارامتر α درصد افزایش در Q را در نتیجه یک درصد افزایش در L اندازه‌گیری می‌کند، در حالی که K را ثابت نگه می‌دارد. به نحو مشابه β درصد افزایش در Q را در نتیجه افزایش یک درصدی در K اندازه‌گیری می‌کند، در حالیکه L را ثابت نگه می‌دارد. بنابراین α و β به ترتیب کشش محصولی L و K هستند (دومینیک، سالواتوره، ۱۳۹۱).

۱-۵) فرضیه‌های پژوهش

ارتباط معناداری بین بحران‌های مالی و میزان تولید کشورهای عضو اوپک وجود دارد.

۱-۶) قلمرو زمانی و مکانی پژوهش

در این پژوهش سعی شده است، کشورهای عضو اوپک در بازه‌ی زمانی ۱۹۷۰-۲۰۱۳ مورد مطالعه قرار گیرد. اما با توجه به محدودیت دسترسی به داده‌های تمامی کشورهای عضو در این بازه‌ی زمانی کشورهای الجزایر، ایران، اکوادور، عربستان سعودی، نیجریه و ونزوئلا مورد مطالعه قرار گرفته‌اند.

۱-۷) روش انجام تحقیق

تحقیقات بر حسب هدف یا نحوه گردآوری اطلاعات (طرح تحقیق) تقسیم‌بندی‌های متفاوتی دارند. بر اساس طرح تحقیق، تحقیق حاضر علی‌پس از وقوع می‌باشد. تحقیق علی‌پس از وقوع

اشاره به مواردی دارد که در آنها علت از پیش رخ داده است و مطالعه آن در حال حاضر از طریق اثری که بر متغیر دیگر- که معلول خوانده می‌شود- گذارده و برجا مانده است، امکان دارد. بر اساس تقسیم‌بندی بر حسب هدف، تحقیق حاضر کاربردی می‌باشد. چرا که هدف این پژوهش کاربرد عملی دانش در تصمیم‌گیری‌ها است و وابسته به مکان و زمان است. اصولاً تحقیقات علی-پس از وقوع کاربردی می‌باشند.

داده‌های این پژوهش با استفاده از مطالعات کتابخانه‌ایی از طریق سایت‌های مختلف بانک جهانی، صندوق بین‌المللی پول، پایگاه داده‌های آماری سازمان ملل و مرکز آمار ایران گردآوری شده است و همچنین کتاب‌ها و مقالات مختلف مرتبط با این موضوع مورد استفاده قرار گرفته است. در نهایت مدل استفاده شده در این پژوهش با استفاده از نرم افزار ایویوز برآورد می‌شود.

۱-۸) ساختار پایان نامه

این پایان‌نامه در پنج فصل تدوین و ضمائم پس از پایان فصل پنجم آورده می‌شود.

فصل اول: کلیات پژوهش

این فصل شامل مقدمه، بیان مسئله، اهداف پژوهش، تعاریف مفهومی و عملیاتی واژگان پژوهش فرضیه‌های پژوهش، قلمرو زمانی، مکانی و موضوعی پژوهش که در قالب روش انجام تحقیق آورده می‌شود.

فصل دوم: مروری بر پیشینه تحقیق