

تقدیم به اساتید عزیزم

دکتر سید عزیز آرمن، دکتر بها الدین نجفی، دکتر منصور زیبایی،
دکتر محمد بخشوده، دکتر برونو ونتلو، دکتر آیشما آشور و دکتر
محمد هاشم پسران

آرشیا امیری

ضمن تشکر و سپاس از اساتید عزیز

دکتر سید عزیز آرمن، دکتر منصور زرا نژاد، دکتر بهاء الدین نجفی،
دکتر منصور زیبایی، دکتر محمد بخشوده، دکتر برونو ونتلو، دکتر
آیشما آشور و دکتر محمد هاشم پسران

آرشیا امیری

چکیده

نام و نام خانوادگی دانشجو:	آرشیا امیری
شماره دانشجویی:	۸۵۱۱۰۰۵
رشته تحصیلی:	علوم اقتصادی
مقطع تحصیلی:	کارشناسی ارشد
محل تحصیل (دانشگاه):	دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی - دانشگاه شهید چمران اهواز
تاریخ فارغ التحصیلی:	۸۸/۶/۳۰
عنوان پایان نامه: بررسی نقش مخارج کارآی دولت در رشد اقتصادی برای منتخبی از کشورهای عضو اپک	
استاد راهنما:	دکتر سید عزیز آرمن
واژگان کلیدی: روش تحلیل فراگیر داده‌ها، زمین آمار، نروفازی، شبکه‌های عصبی، مخارج دولت، رشد اقتصادی، کشورهای نفت خیز	
چکیده	<p>در این پایان نامه به بررسی نقش مخارج کارآی دولت در رشد اقتصادی برای منتخبی از کشورهای عضو اپک میپردازیم، سپس به ترکیب روش تحلیل فراگیر داده‌ها با روش‌هایی چون زمین آمار، نروفازی، شبکه‌های عصبی و روش OLS بمنظور پیش‌بینی نقش مخارج دولت بر رشد اقتصادی این کشورها در کوتاه مدت پرداخته می‌شود. نتایج نشان می‌دهد ضریب سرمایه‌گذاری معنی‌دار نبوده و مخارج دولت بر رشد اقتصادی نقش قابل ملاحظه‌ای ایفا نمی‌کند اما نقش مخارج کارآی دولت بر رشد اقتصادی چشمگیر می‌باشد. نتایج پیش‌بینی نشان می‌دهد که روش‌های هوش مصنوعی توانایی بیشتری نسبت به روش‌های زمین آمار و OLS در پیش‌بینی نقش مخارج کارآی دولت بر رشد اقتصادی دارند.</p>

Abstract

This research probes the role of government expenditure in economic growth by integrating data envelopment analysis (DEA) and adaptive neuro fuzzy inference system, neural networks, geostatistical analysis and OLS in some OPEC member countries. The results show that the parameters of investment and government expenditure are not valid. But the role of effective government expenditure in economic growth is impressive. Results of forecasting show that artificial intelligence methods have better results instead of geostatistical methods and OLS.

عنوان	صفحه
تقدیم	
قدردانی	
فهرست جداول	
فهرست نمودارها	
فهرست جداول	
چکیده	
فصل اول: کلیات	
مقدمه	۲
۱-۱: اهداف	۷
۲-۱: پرسشهای تحقیق	۸
۳-۱: ضرورت انجام تحقیق	۹
۴-۱: معرفی داده ها	۹
نتیجه گیری	۱۱
فصل دوم: مبانی نظری	
مقدمه	۱۳
۱-۲: اندازه دولت	۱۴
۲-۲: تأثیر مخارج مصرفی دولت بر زیر ساختها	۱۵
۳-۲: علل دخالت دولت	۱۶
۱-۳-۲: کالاهای عمومی	۱۶
۲-۳-۲: آثار خارجی و مسائل محیط زیست	۱۷
۳-۳-۲: انجام اصلاحات در سیاستهای مالی	۱۷
۴-۲: وظایف دولت	۱۸
۱-۴-۲: وجود انحصارات	۱۸
۲-۴-۲: نقض بازار	۱۹
۳-۴-۲: تخصیص منابع	۱۹
۴-۴-۲: توزیع عادلانه درآمد	۲۰
۵-۴-۲: کمک به ثبات اقتصادی	۲۰
۵-۲: سیاستهای اقتصادی دولت و رشد اقتصادی	۲۰
نتیجه گیری	۲۵
فصل سوم: پیشینه تحقیق	
مقدمه	۲۷
۱-۳: رشد اقتصادی و مخارج دولت	۲۷
۱-۱-۳: مطالعات ایران	۳۵
۲-۳: کارایی و بهره‌وری	۳۷

۳۸	۳-۳: ترکیب و روش DEA و روش های متداول پیش‌بینی
۳۹	نتیجه گیری

فصل چهارم: روش تحقیق

۴۱	مقدمه
۴۱	۱-۴: روش تحلیل فراگیر یا پوششی داده‌ها
۴۴	۲-۴: شبکه عصبی مصنوعی
۶۰	۱-۲-۴: شبکه‌ی Feed Forward
۶۱	۲-۲-۴: الگوریتم Back-Propagation
۶۲	۳-۴: ساختار مدل نرو فازی
۶۸	۴-۴: تحلیل زمین آمار
۷۱	۱-۴-۴: کریجینگ معمولی
۷۳	۲-۴-۴: وزن دهی فاصله‌ای معکوس (IDW)
۷۴	نتیجه گیری

فصل پنجم: برآورد مدل‌ها و تجزیه و تحلیل نتایج

۷۶	مقدمه
۷۶	۱-۵: معرفی داده‌ها
۷۷	۲-۵: مدل
۷۸	۳-۵: نتایج
۷۹	۱-۳-۵: نتایج داده‌های خام حاصل از روش Catching up effect
۸۰	۱-۱-۳-۵: روش OLS
۸۱	۲-۱-۳-۵: روش شبکه عصبی
۸۱	۳-۱-۳-۵: روش نروفازی
۸۱	۴-۱-۳-۵: روش زمین آمار
۸۲	۲-۳-۵: نتایج داده‌های مخارج کارا حاصل از روش DEA
۸۳	۱-۲-۳-۵: روش OLS
۸۴	۲-۲-۳-۵: روش شبکه عصبی
۸۴	۳-۲-۳-۵: روش نروفازی
۸۴	۴-۲-۳-۵: روش زمین آمار
۸۵	۳-۳-۵: پیش‌بینی نقش مخارج دولت در رشد اقتصادی
۸۵	۱-۳-۳-۵: اعتبارات
۸۶	۲-۳-۳-۵: نتایج پیش‌بینی
۸۹	نتیجه گیری

فصل ششم: خلاصه نتایج و پیشنهادات

۹۲	مقدمه
۹۲	۱-۶: خلاصه، نتایج و پیشنهادات
۹۲	۱-۱-۶: خلاصه پژوهش

۹۳	۶-۱-۲: نتایج تحقیق
۹۳	۶-۱-۳: پیشنهادات تحقیق
	پیوست ها
۹۵	پیوست
	منابع و مآخذ
۱۲۵	منابع فارسی
۱۲۵	منابع فارسی
۱۲۶	منابع انگلیسی
	فهرست جداول
۸۰	جدول ۱.۵. داده های خام
۸۳	جدول ۲.۵. داده کارا و ضرایب کارایی
۸۷	جدول ۳.۵ نتایج روش OLS و پیکربندی های نروفازی
۸۸	جدول ۴.۵ نتایج روش مدل شبکه عصبی تک لایه و چند لایه پنهان، و روش های زمین آمار
	فهرست نمودارها
۴۵	نمودار ۱.۴: ساختار یک رشته عصبی
۴۶	نمودار ۲.۴: نمودار مفهومی شبکه Feed Forward با لایه ی پنهان
۴۸	نمودار ۳.۴: مدل شبکه عصبی ساده پیش خور با یک خروجی
۴۸	نمودار ۴.۴: مدل شبکه عصبی ساده پیش خور با دو خروجی
۵۱	نمودار ۵.۴: تابع لجستیک
۵۴	نمودار ۶.۴: شبکه عصبی پیش خور با یک لایه پنهان
۶۳	نمودار ۷.۴ ساختار یک مدل نروفازی
۷۰	نمودار ۸.۴: نمودار واریوگرام
۸۹	نمودار ۱.۵ مقادیر واقعی و پیش بینی شده رشد توسط پیکربندی نروفازی

فصل اول

کلیات

امروزه اقتصاددانان مطالعات تجربی و نظری بسیاری درباره تأثیر اندازه دولت بر رشد اقتصادی کشورهای مختلف انجام داده‌اند. بر اساس مدل رشد نئوکلاسیک (برونزا)، هر چند سیاست‌های دولت می‌تواند بر نرخ رشد اقتصادی تأثیر داشته باشد ولی این تأثیر کوتاه مدت است و در بلند مدت استمرار نخواهد یافت. در چارچوب الگویی که توسط نظریه پردازان جدید رشد ارائه شده است و به مدل‌های رشد درونزا موسوم است، تغییرات دائمی در متغیرهایی که به صورت بالقوه تحت تأثیر سیاست‌های دولت قرار دارند، می‌تواند تغییرات دائمی در نرخ رشد ایجاد نماید. از نظر منطقی، ترکیب مخارج دولت با برنامه‌های مختلفی نظیر آموزش و پرورش؛ مخارج زیربنایی عمرانی و یارانه‌های تحقیق و توسعه که بر اساس مطالعات نظری تأثیر مثبتی بر رشد دارند، عنصر تعیین کننده‌ای برای دخالت دولت در اقتصاد محسوب می‌گردد. گذشته از این موارد، ادبیات گسترده‌ای وجود دارد که حاکی از تأثیر بسیاری از برنامه‌های عمومی دولت بر پس‌انداز و انباشت سرمایه است که از سیستم مالیاتی سرچشمه می‌گیرد (رجوع کنید به تاری و ستاری، ۱۳۸۴).

اندازه گیری نقش مخارج عمومی دولت بر رشد اقتصادی و سپس پیش بینی مبتنی بر آن از اهمیت بخصوصی در سیاست گذاری‌های اقتصاد کلان برخوردار است، از آن جمله می‌توان به تأثیر سیاست‌های انبساطی و انقباضی دولت بر رشد اقتصادی در کوتاه مدت و نیز نقش آن در تعیین اندازه بهینه‌ی دولت، میزان بهینه‌ی مالیات و غیره اشاره کرد. در بررسی رشد اقتصادی و عوامل مؤثر بر آن، نظریات رشد اقتصادی، عوامل کار و سرمایه بخش خصوصی را به عنوان مهمترین عوامل مطرح می‌کنند. اما گفته می‌شود با افزایش هر چه بیشتر این عوامل در کشورها، به دلیل جاری بودن قانون بازدهی نزولی و کاهش سود سرمایه گذاری، نرخ رشد تولید کمتر و کمتر می‌شود. بارو^۱ (۱۹۹۰) جهت رفع این مشکل نشان داد که از طریق ایجاد یک جریان مداوم مخارج عمومی در فرآیند تولید می‌توان روند نزولی سود سرمایه گذاری را خنثی و از بروز نرخ‌های رشد کاهنده جلوگیری به عمل آورد. بارو رشد سرانه GDP را به عنوان شاخص رشد اقتصادی لحاظ کرد و آن را به صورت $y = f(k, d)$ ارایه کرد که در آن k و d به ترتیب سرمایه خصوصی و مخارج عمومی به ازای یک واحد نیروی کار می‌باشند. این تغییر که به غنی سازی مدل رشد سولو معروف است توجیهی نظری برای دخالت دولت در اقتصاد تلقی می‌شود هر چند که پاسخ‌هایی نیز از جانب مخالفین دریافت کرده است. نظریه رشد بارو در ادبیات اقتصادی برای کشورهای مختلف بارها مورد آزمون قرار گرفته است و نتایج مختلفی را نشان داده است. در این تحقیق نقش مخارج دولت در رشد اقتصادی برای مجموعه‌ای از کشورهای عضو اوپک بررسی و اندازه گیری خواهد شد و بر آن اساس به پیش بینی چنین نقشی اقدام خواهد شد.

^۱ Barro

از آنجا که در مدل رشد بارو (۱۹۹۰) مخارج دولت به عنوان نهاده ای در تابع تولید کلان اقتصادی مطرح شده است، مفهوم کارایی می تواند در مورد آن صدق کند. بدین مفهوم که چگونه می توان با کمترین میزان مخارج دولت به میزان معین و ثابتی از رشد دست یابیم. به عبارت دیگر، مخارج کارای دولت، آن دسته از مخارج اند که روی تابع تولید مرزی کلان اقتصادی قرار می گیرند (رجوع کنید به ونتلو و برای^۱، ۲۰۰۶).

اخیراً تلاش های خوبی در زمینه به دست آوردن رابطه ای بین مخارج عمومی و رشد اقتصادی صورت گرفته است. ونتلو و برای (۲۰۰۶) کاملترین کار را در این زمینه انجام داده اند. آنها در مقاله خود با بکار بردن روش تحلیل پوششی داده ها^۲ که یک رهیافت برنامه ریزی ریاضی غیر پارامتریک برای تخمین مرزهاست (چارنز، کوپر و رودس^۳، ۱۹۷۸) مخارج عمومی را با فاکتور کارایی تصحیح کردند و سپس این نقش را تخمین زدند. با فرض آنها، در تابع تولید کلان اقتصادی که توسط بارو پیشنهاد شده، نهاده های تولید ممکن است برای اهداف مولد و یا برای اهداف دیگر (مثل برنامه های اجتماعی و عام المنفعه، برنامه ریزی اقتصاد ملی و ...) به کار گرفته شود. این وظیفه ماست که دقیقاً مشخص کنیم چه نسبتی از مخارج عمومی برای اهداف مولد و چه نسبتی برای سایر اهداف بکار می رود. این تفکیک جدید مخارج به طور ساده نشان می دهد که ناکارایی منابع، ناکارایی مطلق نیست که بمعنی به هدر رفتن منابع باشد، بلکه بمعنی تولید محصول دیگری است (در اصطلاح محصول پنهان (تاناسولیس^۴، ۲۰۰۱)) که در حین ارزیابی محصول از آن چشم پوشی شده است.

این پایان نامه با مبنا قرار دادن نتایج ونتلو و برای (۲۰۰۶) که تأکید بر لزوم استفاده از روش DEA می باشد، این روش را برای تصحیح داده های مخارج عمومی دولت به کار برده است.

اندازه گیری عملکرد یک اقتصاد در قالب رشد اقتصادی و کارایی و بهره وری کل عوامل، موضوعاتی هستند که مطالعات بسیاری به آن پرداخته اند. برای برآورد بهره وری کل عوامل از تابع تولید و برای برآورد کارایی فنی از روش برنامه ریزی خطی استفاده خواهیم کرد که موسوم به تحلیل فراگیر یا پوششی داده ها است. در ادامه به بررسی عواملی که انتظار می رود بر کارایی و بهره وری اقتصاد اثر بگذارند می پردازیم.

^۱ Ventelou and Bry

^۲ Data Envelopment Analysis

^۳ Charnes, Cooper and Rhodes

^۴ Thanassoulis

از بین روش های مختلف DEA روش بازده متغیر نسبت به مقیاس را برمی گزینیم که مزایایی نسبت به بازده ی ثابت نسبت به مقیاس دارد. از آن جمله تبعیت از مدل رشد بارو (۱۹۹۰) و این که انتخاب بازده ی متغیر نسبت به مقیاس (البته کاهنده) موجب می شود که تابع تولید مرزی کلان اقتصادی همواره در ناحیه ی دوم و کارا از نواحی تولید قرار گیرد.

در دهه های اخیر با رشد روش های فرا ابتکاری و هوش مصنوعی^۶، استفاده از روش های شبکه های عصبی مصنوعی و نروفازی^۷ که شبکه های عصبی^۸ فازی نیز نام دارد بمنظور پیش بینی در علوم مختلف رواج یافته است.

روش های زمین آمار^۹ ابزاری مناسب جهت تخمین و پیش بینی می باشند، این روش ها قابلیت تست و بررسی فرم های مختلفی نظیر خطی^{۱۰}، غیر خطی^{۱۱}، گوسین^{۱۲}، کروی^{۱۳} و غیره را به ما می دهند (رجوع کنید به دیوید^{۱۴} (۱۹۷۷)، کریج^{۱۵} (۱۹۸۱)، کرسی^{۱۶} (۱۹۸۵، ۱۹۹۱)، ایساکس و سریواستاوا^{۱۷} (۱۹۸۹)، هیل و همکاران^{۱۸} (۱۹۹۴)).

زمین آمار تحلیلی معمول برای پیش بینی داده، موقعیت و ساختن نقشه در علمی چون آبیاری، نقشه برداری، محیط زیست، زمین شناسی و جغرافی است که دارای روش های گوناگونی می باشد که ما روش های کریجینگ^{۱۹} و IDW^{۲۰} که معمول ترین روش های تخمین در زمین آمار هستند را بمنظور بررسی و پیش بینی نقش مخارج کارآی دولت در رشد اقتصادی بکار می بریم.

^۱ Artiffical inteligance

^۲ Neuro-fuzzy

^۳ Artiffical neuro-fuzzy network

^۴ Geostatistical Analysis

^۵ linear

^۶ nonlinear

^۷ gussian

^۸ spherical

^۹ David

^{۱۰} Krige

^{۱۱} Cressie

^{۱۲} Issaks and Srivstava

^{۱۳} Hill et. al

^{۱۴} Kriging

^{۱۵} inverse distance weight

در پایان مقایسه ای بین نتایج حاصل از روش های معمول اقتصادی، شبکه‌های عصبی مصنوعی، نروفازی، کریجینگ و IDW بمنظور پیش‌بینی نقش مخارج دولت بر رشد اقتصادی این کشورها در کوتاه مدت برقرار می‌گردد.

۱.۱. اهداف:

در اکثر کشورهای صادر کننده نفت، تولید و صادرات نفت در اختیار دولت است و دولت در تبدیل این ثروت طبیعی به صورتهای مختلف سرمایه برای استفاده نسل حاضر و نسل های آتی نقش مهمی را بر عهده دارد. هدف این تحقیق اندازه‌گیری میزان تأثیر هزینه‌های دولت بر رشد اقتصادی کشورهای عضو اوپک^{۲۱} و در نهایت استفاده از نتایج آن در جهت تدوین نقش دولت به منظور دستیابی به رشد اقتصادی بالاتر است. نتایج حاصل از این تحقیق می‌تواند راهنمایی‌های لازم در رابطه با عملکرد مالیاتها و هزینه‌های دولت در کشورهای صادر کننده نفت را در اختیار مسئولین قرار دهد. اینکه آیا به دلیل وابستگی کشورهای عضو اوپک به درآمدهای نفتی، مخارج دولت به عنوان ابزارهای سیاست گذاری می‌توانند تأثیری مشابه آنچه در نظریات اقتصادی بحث شده است بر رشد اقتصادی داشته باشند یا خیر نیز، از اهداف این بررسی به شمار می‌آید.

اهداف اساسی از انجام تحقیق:

(۱) اندازه

گیری تأثیر مخارج کارای دولت بر رشد اقتصادی کشورهای عضو اوپک

(۲) پیش بینی تأثیر مخارج کارای دولت بر رشد اقتصادی در کشورهای عضو اوپک

۲.۱. پرسشهای تحقیق:

پرسش های اساسی این تحقیق عبارتند از:

الف) نحوه تأثیر مخارج دولت بر رشد اقتصادی کشورهای منتخب چگونه است؟

ب) بهترین روش برای پیش‌بینی نقش مخارج دولت بر رشد اقتصادی کشورهای مختلف چیست؟

۳.۱. ضرورت انجام تحقیق:

اندازه گیری نقش مخارج عمومی دولت بر رشد اقتصادی و سپس پیش بینی مبتنی بر آن از اهمیت بخصوصی در سیاستگذاری های اقتصاد کلان برخوردار است، از آن جمله می توان به تاثیر سیاست های انبساطی و انقباضی

^۱ OPEC members

دولت بر رشد اقتصادی در کوتاه مدت و نیز نقش آن در تعیین اندازه بهینه‌ی دولت، میزان بهینه‌ی مالیات و غیره اشاره کرد.

۴.۱. معرفی داده‌ها

جامعه آماری مورد بررسی سازمان کشورهای صادر کننده نفت، (اوپک) است. این کشورها عبارتند از: الجزایر، اندونزی، امارات متحده عربی، ایران، عراق، عربستان سعودی، کویت، قطر، نیجریه، لیبی، سودان، سوریه، برزیل، بولیوی، عمان، اکوادور و ونزوئلا. به دلیل فقدان اطلاعات مربوط به شاخصهای اصلی مورد استفاده در تحقیق حاضر؛ کشورهای عراق، عربستان سعودی، نیجریه، لیبی و قطر مورد بررسی قرار نگرفته‌اند.

برای تحلیل، نرخ‌های رشد GDP سرانه از دوره زمانی ۲۰۰۵-۱۹۹۵ نسبت به داده‌های خام یکساله که به جمعیت تقسیم گردیده، استفاده شده است. دلایل متعددی برای این انتخاب وجود دارد، در دهه انتخاب شده اکثر کشورهای مورد مطالعه، سیکل‌های اقتصادی شبیه به هم داشتند (کوواریانس ضرایب کشورهای مورد مطالعه در فاصله زمانی فوق نسبت به فواصل دیگر (که فاصله‌ی هر بازه‌ی زمانی با بازه‌ی بعدی ۵ سال در نظر گرفته شده است) کمترین مقدار را داشته است)، بنابراین اختلاف در رشد در نتیجه اختلاف در سیکل‌های اقتصادی نیست بلکه بستگی به کارایی مخارج عمومی دارد (رجوع کنید به ونتلو و برای ۲۰۰۶).

از نظر آزمون همگرایی شرطی، لازم است که این اندازه‌گیری رشد به وسیله فاکتور تعدیل *Catching up effect* (رجوع کنید به ونتلو و برای ۲۰۰۶) بهبود یابد، که در آن با استفاده از فاکتور تعدیل استاندارد OLS (با استفاده از داده‌های تعدیل شده) برای سال ۱۹۹۷، سری داده‌هایی به دست آمده که به عنوان شاخص نرخ رشد تعدیل شده از آن استفاده شده است. با توجه به این شاخص می‌توان درجه رشد اقتصادی کشورها را در این دوره استنباط کرد.

بدلیل محدودیت منابع آماری، سرمایه‌گذاری سرانه سال ۱۹۹۶ به عنوان شاخصی از سرمایه‌گذاری در مدل رشد بارو در نظر گرفته شده است که برای کشورهای کویت، سوریه، عمان، الجزایر و امارات متحده عربی بوسیله روش شبکه عصبی داده‌سازی شده است.

داده‌های رشد اقتصادی، مخارج دولت، سرمایه‌گذاری و جمعیت با توجه به کارکرد آنها، از نرم افزار بین المللی آماری اقتصادی *World Development Indicators 2008* استفاده شده است. داده‌های مخارج دولت و سرمایه‌گذاری بر حسب دلار PPP می‌باشند که با استفاده از شاخص قیمت مصرف کننده آمریکا تورم زدایی شده‌اند (قیمت ثابت سال ۲۰۰۰).

نتیجه گیری

در این فصل به بیان کلیاتی در زمینه اهداف اساسی از انجام تحقیق، پرسشهای تحقیق و ضرورت انجام تحقیق پرداخته شده.

فصل دوم

مبانی نظری

مقدمه

در خصوص دخالت دولت در حوزه فعالیت های اقتصادی نظریات متفاوتی مطرح شده است که اگر بخواهیم این نظریات را تقسیم بندی کنیم؛ چهار دوره را می توان از یکدیگر تفکیک نمود. دوره اول؛ مقارن با تحولات صنعتی در اروپا و اندیشه های اقتصاددانان کلاسیک است.

در این دوره دخالت دولت در اقتصاد محدود به وظایفی از قبیل تأمین امنیت عمومی، دفاع از تمامیت ارضی کشور و سرمایه گذاری در تولید کالاهای عمومی نظیر آموزش و پرورش می باشد که توسط آدام اسمیت مطرح شده بود. بر اساس نظریات دوره دوم که بر اساس رهنمودهای کینز بعد از جنگ جهانی دوم است؛ در بسیاری از کشورهای توسعه یافته نظریه ای رایج شد که بر اساس آن، برای دستیابی به اهداف خاص اقتصادی و اجتماعی مورد نظر، دولت ها می بایست دخالت بیشتری در اقتصاد داشته باشند. بدیهی است که یکی از مهمترین روش هایی که دولت می تواند با استفاده از آن بر اقتصاد تأثیر گذارد و رشد اقتصادی را تحت تأثیر قرار دهد، از طریق افزایش یا کاهش مخارج مصرفی خود و تغییر مالیاتها حاصل می گردد.

آغاز دوره سوم، عملاً مقارن با دهه ۱۹۷۰ است، اعتبار نظرات مربوط به گسترش حجم بخش دولتی، از طریق افزایش مخارج مصرفی دولتی و تغییر مالیات ها، به دلیل نقش بازدارنده آنها در زمینه رشد اقتصادی در اثر از بین بردن انگیزه ها، مورد تردید جدی قرار گرفت و رویکردی موسوم به رویکرد نئولیبرالیستی اندیشه های دولت گرای سوسیالیستی و کینزی را از صحنه خارج کرد و به این ترتیب فضای حاکم بر جهان چنان تحت تأثیر این رویکرد قرار گرفت که اقتصاددانان معتقد به دخالت منطقی دولت - در اقتصاد - به لاک خود فرو رفتند و در موضع انفعالی قرار گرفتند. در چنین شرایطی صندوق بین المللی پول دولت حداقل رابه شدت طرح و عدم اجرای آن را با مجازات هایی پاسخ می گفت. طبق گزارش بانک جهانی، دوره چهارم با تأکید این نهاد بین المللی بر نقش مثبت دولت در تغییر و تحولات اقتصادی از سال ۱۹۹۷ آغاز گردید. در این گزارش بانک جهانی، رویکرد مداخله گرانه دولت در اقتصاد، مورد تردید قرار گرفته است و به جای « دولت حداقلی»، « دولت موافق با بازار» مطرح می شود. در این رویکرد دولت، نهادی است که باید به وسیله وضع قوانین و مقررات، شرایط مناسبی برای کارکرد کارآمد اقتصاد فراهم سازد.

۱.۲. اندازه دولت:

اغلب شنیده می شود که بالا بودن پرداخت های انتقالی تأمین اجتماعی به GDP و بالا بودن سطح مخارج مصرفی دولت می تواند بر روی رشد، اثر مخرب داشته باشد. به هر حال شواهد قوی در تأیید این ادعا ارائه نشده است و به دلیل اختلاف در

شيوه‌های مطالعه و دوره‌های بررسی، محققین به یک نتیجه قطعی و فراگیر از رابطه منفی بین مصرف دولت و رشد اقتصادی دست نیافته‌اند، بنابراین در این مورد اختلاف نظرهای فراوانی وجود دارد؛ لوین و رنلت^{۲۲} (۱۹۹۲) چنین نتیجه گرفته‌اند که همبستگی میان رشد و مخارج مصرفی دولت شکننده است. در ارتباط با اثر پرداختهای انتقالی تأمین اجتماعی بر روی رشد نتایج چنین بیان می‌کنند که ساختار نهادها و مؤسسات دولتی نقش عمده‌ای را ایفا می‌نماید و انجام مطالعات مقطعی نمی‌تواند در شناخت این اثر مفید باشد. بحث‌های مهم دیگری نیز در این ارتباط توسط استرلی و ربلو^{۲۳} (۱۹۹۲) انجام گرفته است که در مجموع در خصوص ارتباط میان مخارج مصرفی دولت و رشد؛ حقایق مسلمی را حداقل در سطح اقتصاد کلان ارائه نمی‌کند. جونز^{۲۴} (۱۹۹۷) بر اساس یک رهیافت کلان به این نتیجه رسیده که مصارف بالای دولت، موجب کاهش سطح درآمد است و نیز اینکه در چارچوب الگوی آنها وجود درونزایی احتمالاً موجب برآورد کمتر از واقع مصارف دولت شده است (تاری و ستاری، ۱۳۸۴).

۲.۲. تأثیر مخارج مصرفی دولت بر زیر ساختها:

در ارتباط با ترکیب مخارج مصرفی دولت پیشرفت‌های بیشتری حاصل شده است. مناقشه‌های زیادی در خصوص نقش و تأثیر سرمایه عمومی در رشد کشورهای توسعه یافته صورت گرفته است. «گرملیچ^{۲۵}» این مناقشه را به صورت ضعیف در ارتباط با مطالعات مقطعی بر روی کشورها، مطرح نموده است. هر چند در کشورهای در حال توسعه کیفیت و کمیت داده‌های مربوط به زیر ساختهای عمومی، با محدودیت مواجه بوده و دور از دسترس به نظر می‌رسد، با این وصف، ملاحظه شده است که توسعه شبکه‌های مخابراتی و ظرفیتهای نیروی برق و سایر اقدامات زیربنایی تأثیر قابل ملاحظه‌ای بر رشد دوره‌های بعدی دارد.

استرلی و ربلو (۱۹۹۳) عنوان داشتند که سهم سرمایه‌گذاری عمومی در حمل و نقل و مخابرات همبستگی شدیدی با رشد دارد. به نظر می‌رسد؛ مخارج زیربنایی بازده اجتماعی سرمایه‌گذاریهای فعلی را افزایش می‌دهد. به هر حال مشکلی که در ارتباط با درونزایی، وجود داشته و معمولاً نمی‌توان آن را با متغیرهای ابزاری حل کرد این است که سرمایه‌گذاریهای زیربنایی گاهی در جهت تغییر انتظارات رشد در آینده صورت پذیرفته و فاقد نقش علیت بر رشد است.

^۱ Levine and Renelt

^۲ Easrerly and Rebelo

^۳ Johnes

^۴ Germlich

۳.۲. علل دخالت دولت:

دلایل مختلفی پیرامون حضور دولت در عرصه اقتصاد از سوی محققان اقتصادی مطرح می‌شوند. به نظر می‌رسد ریشه طرح این مسائل قبل از آن که مبتنی بر مشاهدات تجربی باشد، برگرفته از دیدگاه‌ها و مبانی نظری و فلسفی متفاوت آنها باشد. اما به طور اجمالی، به نظر می‌رسد که موارد زیر از جمله دلایلی باشند که علت وجودی نقش اقتصادی دولت تصور می‌شوند:

۱.۳.۲. کالاهای عمومی:

کالاهای عمومی و یا کالای اجتماعی، کالایی است که مصرف کنندگان می‌توانند به صورت مشترک از آن استفاده کنند و به همین دلیل نیز نوع تقاضای جمعی آن با کالاهای خصوصی متفاوت است. بر این اساس، تقاضای بازار برای یک کالای عمومی، از جمع عمودی آنها حاصل می‌شود.

یکی از مسائل و مشکلات این قبیل از کالاها، اندازه‌گیری پیچیده آنان است. دو ویژگی بسیار مهم این قبیل از کالاها، مصرف غیر رقابتی و استثناء ناپذیری آنان است. از آنجایی که معمولاً کالاهای عمومی به میزان بهینه تأمین نمی‌شوند، افراد ترجیحات خود را صادقانه بیان نمی‌کنند و بنابراین مسئله سواری مجانی به وجود می‌آید. در این شرایط دولت ناچار به تأمین این قبیل از کالاها می‌شود.

۲.۳.۲. آثار خارجی و مسائل محیط زیست:

معمولاً آثار خارجی و مسائل زیست محیطی زمانی ایجاد می‌شوند که مطلوبیت فرد نه تنها به مصرف کالای خود، بلکه به تولید و یا مصرف فرد دیگر نیز بستگی داشته باشد. این مسئله در حوزه تولید کننده نیز وجود دارد. تولید کننده‌ای ممکن است از محصول تولید کننده دیگر ضرر و یا منفعت به دست آورد. بنابراین، می‌توان تصور کرد که کالاهای تولیدی و مصرفی یک عامل اقتصادی می‌توانند در تابع مطلوبیت و یا سود عامل اقتصادی دیگر نیز وجود داشته باشند، این در حالی است که اثرات فوق ممکن است از طریق مکانیسم قیمت مشاهده نشوند. به عبارت دیگر آثار یاد شده در صورت سود و زیان تولید کننده منعکس نمی‌شوند و اصولاً به همین دلیل به آنها اثرات خارجی می‌گویند. در این شرایط، حضور دولت در قالب سیاست‌های مالی و یا اعمال مقررات از قبیل کنترل تولید، می‌تواند مسئله را تا حدودی ترمیم کند.

انجام اصلاحات در سیاست‌های مالی:

دولت می‌تواند از طریق حجم و ترکیب مخارج دولت اقتصاد را از وضعیت رکود، خارج و یا به شدت رونق اقتصادی بی‌افزاید. کاهش حجم فعالیت دولت و بسترسازی برای حضور پر رنگ‌تر بخش خصوصی از طریق سیاست‌هایی همچون خصوصی سازی

و انجام سرمایه‌گذاری‌های زیربنایی، می‌تواند به سرمایه‌گذاری بخش خصوصی رونق بیشتری ببخشد و ثبات و افزایش رشد اقتصادی را در پی داشته باشد.

اصلاح در نظام مالیاتی نیز می‌تواند با انگیزه‌های متفاوتی از قبیل کاهش کسری بودجه و ترمیم ساختار توزیع درآمد، از جمله سیاست‌هایی تلقی شود که مداخله دولت را در اقتصاد توجیه کند.

۴.۲. وظایف دولت:

علاوه بر مباحث فوق، در بحث علل دخالت دولت، می‌توان به صورت کلی و به اختصار به مواردی با عنوان وظایف دولت نیز اشاراتی به شرح ذیل داشت:

۱.۴.۲. وجود انحصارات:

وجود انحصارات سبب می‌شود که وضعیت رقابتی در ساختار بازار حذف شود و به این صورت، دست انحصارگر برای تعیین قیمت انحصاری گشوده شود و زیان قابل توجهی متوجه مصرف‌کنندگان شود. در این شرایط، کنترل بازار می‌تواند از طریق تبانی انجام گیرد. در این جا زمینه‌های حضور دولت مداخله‌گرا به وجود می‌آید و دولت سعی می‌کند که به نوعی به تنظیم بازار بپردازد.

۲.۴.۲. نقض بازار:

اگر شرایط بازار رقابتی بر اثر وجود مسائلی چون عدم اطمینان^{۲۶}، عدم تحرک پذیری عوامل^{۲۷}، تقسیم ناپذیری^{۲۸} و یا عدم عقلانیت^{۲۹} نقض شود، دولت به عنوان بزرگترین نهاد اقتصادی، سعی در ترمیم وضعیت پیش آمده می‌کند. در صورت فقدان اطلاعات، دولت می‌تواند با ابزارهای موجود، به فراهم آوردن اطلاعات گسترده پیرامون وضعیت اقتصادی و پیش‌بینی‌هایی در مورد بازار به کاهش عدم اطمینان کمک و یا تحرک پذیری جغرافیایی و شغلی عوامل تولید را از طریق سیاست‌های حمایتی دنبال کند و یا خود مستقیماً به انجام امور در شرایط عدم تحرک بپردازد.

^{۲۶} Uncertainty

^{۲۷} Immobility

^{۲۸} Indivisibility

^{۲۹} Innationality

۳.۴.۲. تخصیص منابع:

در صورتی بازار می‌تواند از کارایی لازم برخوردار شود، که تخصیص بهینه منابع اقتصادی انجام گیرد. به عبارت دیگر، در صورت عدم تخصیص بهینه اقتصاد، بازار قادر به رسیدن به بالاترین کارایی مورد نظر نیست. در شرایطی که سیستم بازار از تخصیص بهینه منابع ناتوان است، دولت می‌تواند با دخالت، موانع پیش روی تخصیص بهینه منابع را بردارد و اقتصاد را به کارایی نزدیک کند.

۴.۴.۲. توزیع عادلانه درآمد:

در شرایطی که توزیع درآمد در جامعه ناعادلانه شود، دولت می‌تواند با استفاده از ابزارهایی همچون نظام مالیاتی و یا سازماندهی نظام پرداخت یارانه، توزیع درآمد را عادلانه‌تر کند. افزایش مخارج دولت در بخش‌هایی نظیر بهداشت، تغذیه کودکان و نظام آموزشی، به خصوص برای طبقات کم درآمد، می‌تواند در توزیع مجدد درآمد به نفع طبقات کم درآمد مؤثر باشد و به این ترتیب توزیع درآمد در جامعه عادلانه‌تر شود.

۵.۴.۲. کمک به ثبات اقتصادی:

در شرایطی که اقتصاد مشکلاتی نظیر تورم و بیکاری دست به گریبان است و راه‌های بازاری نمی‌تواند اقتصاد کلان را در شرایط مطلوبی پیش ببرد و این مشکلات به ثبات اقتصادی آسیب‌های جدی وارد می‌کند دولت می‌تواند از طریق سیاست‌های عمومی نظیر سیاست‌های پولی و مالی، سعی در تثبیت اقتصاد کند. به طور مثال، دولت می‌تواند از طریق افزایش تقاضای کل، بر اشتغال تأثیر گذارد و یا با سرمایه‌گذاری بر زیربنای اقتصادی نظیر آموزش، حمل و نقل و بهداشت، سیاست مکملی برای سرمایه‌گذاری بخش خصوصی در پیش گیرد، که به نوبه خود می‌تواند به کاهش قیمت تمام شده کالاها و خدمات منجر شود.

۵.۲. سیاست‌های اقتصادی دولت و رشد اقتصادی:

در نظریه اقتصاد خرد، دامنه محدودی برای فعالیت دولت در نظر گرفته شده است و فعالیت دولت تنها به عرضه کالاهای عمومی محدود می‌شود. در سال ۱۹۵۹، ریچارد ماسگریو^{۳۰} وظایف اقتصادی دولت را به سه گروه: وظیفه تخصیص؛ وظیفه تثبیت؛ و وظیفه توزیع تقسیم نمود. از نظر او، وظیفه تخصیص؛ مجموعه سیاست‌های دولت، نظیر عرضه کالاها، خدمات عمومی و وضع قوانین مختلف - که به نحوی در فعالیتهای اقتصادی جامعه تأثیر داشته و در جهت تخصیص منابع بین دو بخش خصوصی و عمومی صورت می‌گیرد - را شامل می‌شود. وظیفه توزیع شامل برنامه‌هایی است که دولت در ارتباط با توزیع درآمد

^{۳۰} Richard Muasgerio

و ثروت بین گروه‌های مختلف جامعه جهت مبارزه با فقر، تعدیل فاصله طبقاتی و نیز کمک به گروه‌های کم درآمد جامعه اعمال می‌نماید. وظیفه تثبیت نیز شامل برنامه‌های مختلف صورت گرفته توسط دولت، برای دستیابی به اهدافی چون کنترل قیمت‌ها، اشتغال کامل و رشد اقتصادی است.

در ادبیات اقتصاد سیاسی رشد، گستردگی زیادی به چشم می‌خورد. در این گروه از نظریات رشد، تلاش برای بررسی رشد اقتصادی به عنوان متغیری درونزا است که تحت عوامل چندی و رای پیشرفت فنی و رشد جمعیت می‌باشد. لذا اقتصاد سیاسی کلان نیز عوامل تعیین کننده درونزایی را معرفی می‌کند که بر انتخاب سیاستها تأثیر دارند و فراتر از دامنه الگوهای اقتصاد کلان قرار می‌گیرند، در حالی که پیش از این عموماً انتخاب سیاست را به عنوان متغیری برونزا یا انتخابی از سوی برنامه ریزان خیرخواه اجتماعی می‌پنداشتند. نو بودن و تازگی نگرش اقتصاد سیاسی کلان توجه و تأکید بر فرآیند سیاسی و درگیریه‌ها و چالشهای بین افراد، از ویژگی‌های این نظریات بوده که به عنوان عوامل تعیین کننده انتخاب سیاست نیز محسوب می‌گردد.

امروزه طی مطالعاتی به بررسی روابط مختلف میان توزیع درآمد و رشد اقتصادی، بی‌ثباتی سیاسی و رشد اقتصادی، حقوق سیاسی، مردم سالاری و رشد اقتصادی و تأثیر پس انداز و سرمایه‌گذاری بر بی‌ثباتی سیاسی پرداخته‌اند؛ که این موضوع حاکی از نگرش اقتصاددانان به رشد اقتصادی از زاویه درونزا بودن رشد است. از این دیدگاه، سیاست مالی دولت، توسط دو ساز و کار اقتصادی و سیاسی نقش اساسی ایفا می‌نماید. از بعد نخست اقتصادی؛ یعنی به لحاظ اقتصادی، دولت با مخارج خود و مالیاتها، از سویی انگیزه پس انداز و سرمایه گذاری را تحت تأثیر قرار می‌دهد و از سوی دیگر؛ به طور مستقیم با صرف مخارج خود بر تحقیق و توسعه؛ زیر ساختارها و آموزش و پرورش، نرخ رشد را نیز تحت تأثیر قرار می‌دهد. از بعد دوم که سیاسی است؛ مخارج دولت و مالیات ها، به نحوه شکل‌گیری دولت از طریق فرآیند رأی دهی کاملاً دموکراتیک و ایده‌هایش از توزیع درآمدها در جامعه بستگی دارد.

دخالت دولت در اقتصادهای کوچک از دیدگاه اقتصاد سیاسی به گونه دیگری حول دو محور اصلی بروز می‌نماید، یکی بهره‌برداری از صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس؛ و دیگری اداره تضادهای راهبردی میان گروه‌های سازمان یافته است. بطور مثال اگر مؤسسات نتوانند از طریق سیاست‌های سرمایه گذاری هماهنگ، پژوهش‌های مشترک یا تلفیقی، از صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس استفاده کنند به طور منطقی استدلال می‌شود که بایستی دولت در سیاست صنعتی دخالت نماید. از طرف دیگر اگر صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس به ویژگی ساختار اقتصادی و وجود انحصار چند جانبه با منشاء ساختار سیاسی صنف‌گرا مربوط شود، دولت به طور اجتناب ناپذیر باید نقش یک داور و مدیر را برای حل اختلافات راهبردی ایفا نماید.