



دانشکده علوم انسانی و اجتماعی
گروه اقتصاد

عنوان پایان نامه

جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد در رشته اقتصاد توسعه و برنامه ریزی

بررسی همگرایی نوع بتا بین ایران و کشورهای منتخب اسلامی

استاد راهنما

دکتر فیروز فلاحی

استاد مشاور

دکتر بهزاد سلمانی

پژوهشگر

سیمین کیانی

زمستان ۱۳۸۹

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

تقدیم به:

پدر و مادر مهربانم و همسر عزیزم

سرچشمه‌های بی ریای مهربانی و
فداکاری، که بزرگواریشان تکیه گاهم
شد تا ایستادن را پیاموزم و نام پاکشان
دلیلی شد تا افتخارانه سر بالا گیرم . که
لذت و غرور دانستن، جسارت خواستن،
عظمت رسیدن و تمام تجربه های یکتا
وزیبای زندگیم مدیون حضور سبز
آن‌هاست.

خداوندا توانم ده تا قطره‌ای از دریای
بی‌کران محبتشان را سپاس گویم.

سپاس و قدردانی از:

پروردگارم، یگانه معشوق ازلی و ابدی که به من فرصت داد تا عمر خویش را در راه تحصیل علم و دانش سپری کنم و همواره استادانی دلسوز و فرزانه بر سر راهم قرار داد تا در این راه دراز و بی‌پایان علم‌جویی، راهنمای راهم و تسکین‌آتش‌سیری ناپذیرم باشند.

قدردانی و سپاس فراوان از راهنمای دلسوز و فرزانه، مشوق راه علم، استاد ارجمندم جناب آقای دکتر فیروز فلاحی که سهم عمده به ثمر رسیدن این پایان‌نامه بر دوش ایشان بود که با علم و دانش بی‌حد خود، صبر و شکیبایی و راهنمایی‌های ارزنده خود مرا در اتمام این پایان‌نامه یاری کردند.

نام خانوادگی: کیانی

نام: سیمین

عنوان پایان نامه: بررسی همگرایی نوع بتا بین ایران و کشورهای منتخب اسلامی

از جناب آقای دکتر بهزاد سلمانی و جناب آقای دکتر
رضا رنجپور نیز صمیمانه تشکر و قدردانی
می‌نمایم که با راهنمایی‌های ارزنده خود در
پربارتر شدن هرچه بیشتر این پایان نامه ما را یاری
کردند.

از خانواده عزیزم که همواره پشتیبانم بوده‌اند
سپاسگذارم.

و سپاس از آنان که آفتاب مهرشان در آستانه قلبم
هم چنان پا بر جاست و هرگز در یادم خاطرات
شیرین در کنارشان بودن غروب نخواهد کرد،
دوستانم.

استاد راهنما: دکتر فیروز فلاحی

استاد مشاور: دکتر بهزاد سلمانی

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

دانشگاه: تبریز دانشکده: علوم انسانی و اجتماعی تعداد صفحات: ۹۴ تاریخ فارغ التحصیلی: بهمن ۸۹

واژه‌های کلیدی: همگرایی بتا، کشورهای اسلامی، اقتصادسنجی سری زمانی، درآمد سرانه، شکست ساختاری.

طبقه بندی JEL : C22 ، O47 .

چکیده:

در این مطالعه سعی شد با متدولوژی جدید سری زمانی، همگرایی درآمد سرانه بین کشورهای اسلامی مورد مطالعه قرار گیرد. نکته تمایز این مطالعه از مطالعات مشابه این می باشد که در بررسی همگرایی بیشتر از داده‌های مقطعی یا پانل دیتا استفاده می‌شود، ولی این مطالعه از متدولوژی سری زمانی که توسط وگل‌سنگ^۱ (۱۹۹۸)، پیشنهاد شده استفاده می‌کند. نقطه قوت این روش این است که نتایج برآوردی بسته به این‌که متغیرها انباشته از درجه صفر باشند یا انباشته از درجه یک، تغییر نکرده و در عین حال امکان وجود شکست ساختاری را نیز در نظر می‌گیرد. نتایج برآوردی حاکی از وجود همگرایی بتا در اکثر کشورهای اسلامی به سمت مقدار متوسط درآمد سرانه این گروه از کشورها می‌باشد. در این میان، شواهد حاکی از وجود واگرایی در کشورهای کامرون، اندونزی، مالزی، نیجر، چاد و توگو می‌باشد که این واگرایی برای کشورهای چاد و توگو قبل از شکست ساختاری و برای سایر کشورها بعد از شکست ساختاری اتفاق افتاده است. هم‌چنین در این مطالعه تاریخ شکست درآمد سرانه کشورهای اسلامی نیز تخمین زده شده و در مورد دلایل آن

¹ Vogelsang (1998)

بحث شده است. در این مطالعه هم چنین برای بررسی همگرایی تصادفی کشورهای اسلامی دو آزمون ریشه واحد بر روی متغیر درآمد سرانه این گروه از کشورها انجام گرفت، نتایج آزمون ADF بیانگر همگرایی تصادفی کشورهای نیجر، نیجریه، الجزایر، کامرون، گابن، موریتانی، عمان و سنگال بود، و اما آزمون KPSS برای اکثر کشورهای اسلامی همگرایی را نشان داد به جز کشورهای بنین، گابن، ایران و نیجریه که این آزمون نتوانست فرضیه صفر مبنی بر وجود ریشه واحد برای کشورهای مذکور را رد کند.

فصل اول: کلیات تحقیق

..... ۲	۱-۱- مقدمه
..... ۳	۲-۱- بیان مسئله
..... ۴	۳-۱- اهمیت و ضرورت موضوع
..... ۵	۴-۱- هدف تحقیق
..... ۵	۵-۱- فرضیه تحقیق
..... ۶	۶-۱- روش تحقیق
..... ۶	۷-۱- نمونه آماری و دوره زمانی تحقیق
..... ۷	۸-۱- محدودیت تحقیق
..... ۷	۹-۱- سازماندهی تحقیق

فصل دوم: مروری بر ادبیات موضوع

..... ۹	۱-۲- مقدمه
..... ۹	۲-۲- مبانی نظری
..... ۱۱	۲-۲-۱- رشد اقتصادی
..... ۱۱	۲-۲-۲- تابع تولید
..... ۱۳	۲-۲-۲-۱- تابع تولید کاب-داگلاس
..... ۱۴	۲-۲-۳- مدل رشد سولو
..... ۱۴	۲-۲-۳-۱- مفروضات اساسی
..... ۱۶	۲-۳-۲- پویایی سرمایه
..... ۲۰	۲-۳-۳- پس انداز و تولید
..... ۲۱	۲-۳-۴- پس انداز و مصرف
..... ۲۳	۲-۳-۵- رشد جمعیت و پیشرفت تکنولوژی

..... ۲۵	۶-۳- انتقاداتی بر مدل رشد سولو
..... ۲۷	۴-۲-۲- مدل رشد درونزا
..... ۲۸	AK مدل ۱-۴-۲-۲
..... ۲۹	۵-۲-۲- مفاهیم همگرایی
..... ۳۱	۱-۵-۲-۲- همگرایی بتا
..... ۳۱	۲-۵-۲-۲- همگرایی سیگما
..... ۳۳	۳-۵-۲-۲- همگرایی قطبی (باشگاهی)
..... ۳۴	۴-۵-۲-۲- همگرایی شرطی
..... ۳۵	۵-۵-۲-۲- همگرایی تصادفی
..... ۳۶	۳-۲- پیشینه تحقیق
..... ۳۶	۱-۳-۲- پیشینه تحقیق در خارج از کشور
..... ۴۰	۲-۳-۲- پیشینه تحقیق در داخل کشور
..... ۴۳	۴-۲- جمع بندی فصل
	فصل سوم: روش شناسی تحقیق
..... ۴۵	۱-۳- مقدمه
..... ۴۵	۲-۳- همگرایی تصادفی
..... ۴۶	۳-۳- همگرایی بتا
..... ۵۲	۴-۳- تخمین نقطه شکست
..... ۵۳	۵-۳- ویژگی های مدل وگلسنگ

فصل چهارم: بررسی روند متغیر تحقیق

.....۵۵	۴-۱- مقدمه
.....۵۵	۴-۲- توصیف آماری متغیرهای مورد بررسی
.....۵۶	۴-۳- بررسی روند نموداری متغیر درآمد سرانه کشورهای اسلامی
.....۶۳	۴-۴- جمع‌بندی فصل

فصل پنجم: برآورد مدل و تجزیه و تحلیل یافته‌های تحقیق

.....۶۵	۵-۱- مقدمه
.....۶۵	۵-۲- آزمون ایستایی متغیرها
.....۶۸	۵-۳- آزمون همگرایی بتا
.....۷۹	۵-۴- جمع‌بندی فصل

فصل ششم: خلاصه، نتیجه‌گیری و ارائه توصیه‌های سیاستی

.....۸۲	۶-۱- مقدمه
.....۸۲	۶-۲- مروری بر خطوط کلی پژوهش
.....۸۶	۶-۳- نتیجه‌گیری
.....۸۷	۶-۴- توصیه‌های سیاستی
.....۸۹	۶-۵- پیشنهادهایی برای پژوهش‌های آتی
.....۹۰	منابع و مأخذ الف- فارسی
.....۹۱	ب- انگلیسی

الف) جدول‌ها

- جدول (۱-۲): خلاصه مطالعات تجربی صورت گرفته در خارج کشور ۳۹
- جدول (۲-۲): خلاصه مطالعات تجربی صورت گرفته در داخل کشور ۴۲
- جدول (۱-۵): نتایج آزمون ریشه واحد برای متغیر مدل ۶۵
- جدول (۲-۵): نتایج آزمون وگلسنگ و تخمین رگرسیون Z_t و آماره $t-ps_t$ بدون لحاظ تصحیح J_t و تخمین نقطه شکست ۶۸
- جدول (۳-۵): نتایج آزمون وگلسنگ و تخمین رگرسیون Z_t و آماره $t-ps_t$ با لحاظ تصحیح J_t و تخمین نقطه شکست ۷۰
- جدول (۴-۵): نتایج آزمون وگلسنگ و تخمین رگرسیون Y_t و آماره $t.y$ و $T^{-1/2}$ و تخمین نقطه شکست ۷۳
- جدول (۵-۵): خلاصه نتایج جداول (۲-۵)، (۳-۵) و (۴-۵) ۷۵

ب) نمودارها

نمودار (۱-۲): نمودار تابع تولید خطی ۱۲

نمودار (۲-۲): نمودار تابع تولید $y=f(k)$ ۱۵

نمودار (۳-۲): نمودار نشانگر نقطه تعادلی $\Delta k = 0$ ۱۸

نمودار (۴-۲): نمودار نرخ رشد سرمایه سرانه ۱۹

نمودار (۱-۳): نمودار واگرایی ۴۷

نمودار (۲-۳): نمودار همگرایی ۴۷

نمودار (۱-۴): روند y_t کشورهای الجزایر، بنگلادش، بنین و بورکینافاسو ۵۶

نمودار (۲-۴): روند y_t کشورهای کامرون، چاد، مصر و گابن ۵۸

نمودار (۳-۴): روند y_t کشورهای گویان، اندونزی، ایران و مالزی ۵۹

نمودار (۴-۴): روند y_t کشورهای موریتانی، مراکش، نیجر و نیجریه ۶۰

نمودار (۵-۴): روند y_t کشورهای عمان، پاکستان، سنگال و سیرالئون ۶۱

نمودار (۶-۴): روند y_t کشورهای سودان، سوریه، توگو و تونس ۶۲

نمودار (۱-۵): چگونگی پراکندگی نقاط شکست ساختاری در روند درآمد سرانه کشورهای اسلامی ۷۷



۱-۱- مقدمه

تعمیق همگرایی میان کشورهای اسلامی از دغدغه های جدی کشورهای اسلامی است که می تواند در صورت تحقق، منافع اقتصادی، سیاسی و امنیتی قابل توجهی برای این کشورها و جامعه اسلامی به همراه داشته باشد. امروزه گسترش وابستگی متقابل کشورها، جهانی شدن فعالیت ها و شکل گیری نظام های نوین بین المللی، جلوه های از همگرایی های اقتصادی در نظام جدید اقتصاد جهانی است، که این همگرایی های اقتصادی بر این اصل استوار هستند که منافع همه کشورهای مشارکت کننده را اعتلا بخشند و هم چنین اعضا را برای ادغام موفق تر در نظام جدید بین المللی آماده سازند تا منافع بیشتری نصیب آن ها شود. سازمان کنفرانس اسلامی^۱ (OIC) به عنوان بزرگ ترین تشکل سیاسی و اقتصادی در زمینه گسترش همکاری های میان کشورهای اسلامی در تمام حوزه های سیاسی، اقتصادی، فرهنگی و اجتماعی تاسیس شده است. از آنجایی که درآمد سرانه یک کشور معیاری از وضعیت اقتصادی آن کشور است، لذا پایان نامه حاضر سعی خواهد کرد همگرایی درآمد سرانه کشورهای عضو سازمان کنفرانس را مورد مطالعه قرار داده و روند درآمد سرانه کشورهای اسلامی را با یکدیگر مقایسه کند.

در این فصل، به کلیات تحقیق که شامل بیان مسأله، ضرورت و اهمیت تحقیق، هدف، فرضیه، روش تحقیق، نمونه آماری و دوره زمانی، محدودیت ها و سازماندهی تحقیق است، پرداخته می شود.

¹ Organization of the Islamic Conference

۱-۲- بیان مسئله

در سال‌های اخیر کشورهای جهان سوم که کشورهای اسلامی نیز بیشتر در این منطقه قرار دارند، شاهد تحمیل خسارات و هزینه‌های ناخواسته منبعت از ساز و کارهای اقتصاد جهانی بوده‌اند. لذا در جهت رشد و پیشرفت منطقه‌ای، لزوم همگرایی و دوری از واگرایی در بین کشورهای مذکور بیشتر از هر زمان دیگری احساس می‌شود. در چنین شرایطی تلاش محققان و اندیشمندان کشورهای اسلامی در جهت رویارویی با چالش‌های مذکور با اقداماتی از قبیل ارائه طرح‌های نو برای ارتقای ساختارهای مالی بین‌المللی و منطقه‌ای و جلب توجه سیاستگذاران در استفاده موثرتر از طرح‌های همگرایی، موجبات تحکیم روابط اقتصادی، تجاری و تحقق منافع مشترک کشورهای اسلامی را فراهم خواهد کرد. قطعاً در این رویکرد، سازوکارهای منطقه‌ای و چندجانبه، می‌توانند از موقعیت مناسب تری در پیشبرد این اهداف برخوردار باشند. از طرف دیگر امروزه ساختار مالی و اقتصادی جهان چالش‌های نوینی پیش روی توسعه و پیشرفت کشورهای اسلامی قرار داده است؛ چالش‌هایی که اشتغال، امنیت غذایی و ثبات اقتصادی را بویژه در جهان اسلام به مخاطره انداخته است. فلذا ایجاب می‌کند که کشورهای اسلامی شرایط کنونی جهان را فرصتی مهم برای تعمیق همگرایی قلمداد نمایند. این امر نیازمند توجه سیاستمداران، سیاستگذاران، مقامات، علما، اندیشمندان، دانشمندان و نخبگان جهان اسلام به اهمیت ارتقاء طرح‌های همگرایی اقتصادی فی‌مابین کشورهای اسلامی می‌باشد. در این میان توجه دادن به استفاده از تجربیات حاصل از بحران اقتصادی اخیر در جهان غرب و درس گرفتن از اشتباهات کشورهای غربی، از وظایف محققان و اندیشمندان جهان اسلام است.

۱-۳- اهمیت و ضرورت موضوع

دستیابی به رشد و توسعه اقتصادی یکی از اهداف مهم اقتصادی تمام کشورها به شمار می رود. در عین حال، وجود نابرابری، ما بین کشورها از دیگر موارد بسیار اساسی و مطرح برای سرپاس‌گذاران کشورها می‌باشد. وجود این نابرابری بین کشوری و حتی بین مناطق مختلف داخل هر کشور می تواند منجر به ایجاد نارضایتی و تنش‌های اجتماعی گردد. بنابراین کشورها به دنبال آن هستند که فاصله درآمدی خود را از سطح درآمد تعادل باثبات کشور خود و نیز درآمد کشورهای مشابه خود کاهش دهند. یعنی به عبارت دیگر تمام کشورها به دنبال همگرایی به سمت سطح درآمدی مطلوب ب می‌باشند. در واقع آن چه موجب شکل‌گیری تحقیقات پیرامون همگرایی و عوامل موثر بر آن گردیده، اهمیت کاهش فاصله و شکاف درآمدی بین مناطق یا کشورها بوده است. آن چه مسلم است دنیای امروز نیاز مبرم به همگرایی در عرصه‌های اقتصادی، سیاسی، فرهنگی و اجتماعی دارد و روند جهانی شدن نیز، ملت‌های دنیا را به سمت همگرایی منطقه ای و جهانی کشانده است. در چنین چرخه‌ای باید جهان اسلام بیشتر از پیش بر همگرایی بین کشورهای اسلامی تاکید نماید. چراکه وجود نابرابری برای مدت طولانی به معنای وجود و تشدید واگرایی بین کشورهای اسلامی می‌باشد که این امر سبب می‌شود تا مردم کشورهایی که درآمد سرانه شان پایین تر از بقیه هست و از وضعیت اقتصادی و معیشتی پایین تری برخوردارند نارضایتی خود را به وسیله ایجاد مشکلات سیاسی و اجتماعی بروز دهند. بنابراین دانستن این موضوع که آیا این کشورها به سمت همگرایی دیگر همگرا می‌شوند یا واگرا، می‌تواند به سیاستگذاران برای تصمیم‌گیری‌های مناسب کمک شایانی نماید.

در این پایان‌نامه با توجه به اهمیت شکست‌های ساختاری در بررسی‌های اقتصادی سعی خواهد شد تا مسئله همگرایی بین ایران و کشورهای منتخب اسلامی با استفاده از روش‌های جدید اقتصادسنجی سری زمانی و لحاظ کردن امکان شکست ساختاری مورد بررسی قرار گیرد. نکته تمایز این مطالعه از مطالعات مشابه این می‌باشد که در بررسی همگرایی بیشتر از داده های مقطعی یا پانل دیتا استفاده شده است ، ولی این مطالعه از متدولوژی سری زمانی که توسط وگل‌سنگ (۱۹۹۸) پیشنهاد شده استفاده می‌کند. نقطه قوت این روش این است که نتایج برآوردی بسته به اینکه متغیرها انباشته از درجه صفر باشد یا انباشته از درجه یک، تغییر نخواهد کرد.

۱-۴- هدف تحقیق

۱- مروری بر فرآیند همگرایی بتا در قالب مدل های رشد به لحاظ تئوری با ابزار اقتصادسنجی سری زمانی.

۲- بررسی وضعیت همگرایی ایران و کشورهای اسلامی.

۱-۵- فرضیه تحقیق

در میان کشورهای اسلامی مورد بررسی ، کشورهای دارای GDP سرانه پایین تر، رشد سریع تری نسبت به کشورهای با GDP سرانه بالاتر دارند.

و یا، در بین کشورهای اسلامی مورد بررسی و کشور ایران همگرایی بتا مشاهده می‌شود.

۱-۶- روش تحقیق

مطالعه حاضر به لحاظ هدف از نوع تحقیقات کاربردی و به لحاظ روش تجزیه تحلیل از نوع تحقیقات تحلیلی می‌باشد. آمار اطلاعات مورد نیاز تحقیق به روش اسنادی یا کتابخانه‌ای جمع‌آوری شده‌اند. برای بررسی همگرایی بتا نیز از متغیر درآمد سرانه برای کشورهای منتخب اسلامی استفاده می‌شود، که همگرایی بتا نسبت به متوسط درآمد سرانه کشورهای منتخب بررسی می‌شود. در ضمن برای تخمین مدل از دو نرم افزار EViews6 و GAUSS 8 استفاده شده است.

۱-۷- نمونه آماری و دوره زمانی تحقیق

در این پایان نامه از داده‌های مربوط به GDP سرانه به دلار ثابت ۲۰۰۰^۱ مستخرج از پایگاه بانک جهانی ۲۰۰۸، WDI^۲ استفاده شده است. کشورهای مورد مطالعه ۲۴ کشور اسلامی شامل ایران، مصر، اندونزی، مالزی، نیجریه، عمان، پاکستان، سودان، سوریه، الجزایر، بنگلادش، بنین^۳، تونس، کامرون، گابن، مراکش، چاد، موریتانی، سنگال، سیرالئون، بوركینافاسو، توگو، نیجر و گویان^۴ بوده و سال‌های مورد بررسی ۱۹۶۵-۲۰۰۶ می‌باشد.^۵

^۱ GDP per capita (constant 2000 US\$)

^۲ World development indicators 2008

^۳ Benin

^۴ Guyana

^۵ دلیل انتخاب کشورها و دوره زمانی فوق، دسترسی به آمار و اطلاعات می‌باشد.

۱-۸- محدودیت تحقیق

محدودیت تحقیق مربوط به داده های مورد نیاز تحقیق می باشد. با توجه به اینکه در برآورد مدل، هر چه تعداد مشاهدات بیشتر باشد، نتایج تخمین دقیق تری به دست خواهد آمد، بنابراین عدم دسترسی به مشاهدات بیشتر، یکی از محدودیت های اساسی تحقیق بوده است.

هم چنین به دلیل عدم دسترسی به داده های برخی کشورها، نظیر ترکیه، امارات و ... بررسی همگرایی این کشورها از متوسط درآمد سرانه این گروه از کشورها میسر نشد.

۱-۹- سازماندهی تحقیق

این تحقیق در ۶ فصل سازماندهی شده است. بعد از مرور کلیات تحقیق در فصل اول، در فصل دوم ادبیات تحقیق (مبانی نظری و پیشینه تحقیق) مرور می شود. فصل سوم به معرفی روش شناسی تحقیق و مباحث اقتصادسنجی مورد استفاده در تحقیق اختصاص دارد. فصل چهارم به بررسی آمار توصیفی متغیر و در فصل پنجم برآورد مدل، تجزیه و تحلیل یافته های تجربی تحقیق ارائه شده و سرانجام در فصل پایانی، نتیجه گیری و پیشنهادها ارائه شده است.

