

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشگاه صنعتی اصفهان
دانشکده صنایع و مرکز برنامه‌ریزی سیستم‌ها

تأثیر نوسانات قیمت نفت بر رشد اقتصادی ایران (۱۳۳۸-۱۳۸۶)

پایان نامه کارشناسی ارشد برنامه‌ریزی سیستم‌های اقتصادی

فاطمه دستگردی

استاد راهنما
دکتر اکبر توکلی



دانشگاه صنعتی اصفهان

دانشکده صنایع و مرکز برنامه‌ریزی سیستم‌ها

پایان نامه کارشناسی ارشد برنامه‌ریزی سیستم‌های اقتصادی فاطمه دستگردی
تحت عنوان

تأثیر نوسانات قیمت نفت بر رشد اقتصادی ایران (۱۳۸۶-۱۳۳۸)

در تاریخ ۸۸/۴/۱۴ توسط کمیته تخصصی زیر مورد بررسی و تصویب نهائی قرار گرفت:

دکتر اکبر توکلی

۱- استاد راهنما

دکتر سید نادر شتاب بوشهری

۲- استاد مشاور

دکتر علی همدانی

۳- استاد داور

دکتر بهروز ارباب شیرانی

سرپرست تحصیلات تحصیلی دانشکده

تشکر و قدر دانی

ملکا ذکر تو گویم که تو پاکی و خدایی
همه درگاه تو جویم، همه از فضل تو پویم
تو حکیمی تو عظیمی تو کریمی تو رحیمی
نتوان وصف تو گفتن که تو در فهم نگنجی

نروم جزء به همان ره که توام راهنمایی
همه توحید تو گویم که به توحید تو سزایی
تو نماینده فضلی، تو سزاوار ثنایی
نتوان شبه تو جستن که تو در وهم نیایی

مراتب سپاس و قدر دانی خود را به محضر پدر، مادر، برادران و خواهر عزیز و مهربانم که همیشه در طول سال‌های تحصیل، حامی و مشوقم بوده‌اند ابراز می‌دارم.

از جناب آقای دکتر اکبر توکلی استاد عزیزم که اندیشیدن را به من آموختند و با صبر و هدایت فرزانه خود، مرا در انجام این پایان‌نامه یاری دادند و با لطف علمی و اخلاقی خود، تحصیل در مقطع کارشناسی ارشد را برایم آسان نمودند، مراتب سپاس و تشکر را دارم و توفیق ایشان را از خداوند منان خواستارم.

همچنین از جناب آقای دکتر سید نادر شتاب بوشهری بخاطر مشاوره‌های ارزنده‌شان صمیمانه کمال تشکر را دارم.

از جناب آقای دکتر علی همدانی که زحمت داوری این پایان‌نامه را برعهده داشتند، نیز سپاسگزاری می‌کنم.

از جناب آقای دکتر بهروز ارباب شیرانی سرپرست محترم تحصیلات تکمیلی تشکر و قدر دانی می‌نمایم.

در پایان لازم می‌دانم قدردان دوستان و همکلاسی‌های عزیز که در همکاری با اینجانب از هیچ کمکی دریغ نوزیدند، باشم.

همچنین از دوستان و همکلاسی‌های عزیزم که در طی دوران تحصیلی اینجانب، همواره دعای خیرشان بدرقه راهم بوده و سبب‌ساز امیدواری‌ام گشته‌اند، صمیمانه تشکر و قدر دانی می‌نمایم؛ امید است همواره مؤید به تائیدات الهی و موفق به توفیقات ربانی باشند.

با تقدیم احترام
فاطمه دستگردی

کلیه حقوق مادی مترتب بر نتایج مطالعات، ابتکارات و نوآوریهای ناشی از تحقیق موضوع این پایان نامه متعلق به دانشگاه صنعتی اصفهان است.

تقدیم به:

پدر بزرگوار

و

مادر مهربانم

که دستانم به یادشان نوشت در اوج خستگی
چشمانم به یادشان درخشید در اوج فروماندگی

و

اینک ثمره کوچک دستانم را تقدیم به بزرگواری شان می کنم
تا خرده نگینی باشد بر دستهای مهربانشان.

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
هشت	فهرست مطالب
۱	چکیده
	فصل اول: کلیات تحقیق
۲	۱-۱ مقدمه
۳	۲-۱ ضرورت تحقیق
۳	۳-۱ سؤالات تحقیق
۳	۴-۱ زمینه یا فرضیه‌های مورد آزمایش
۴	۵-۱ روش تحقیق و جمع‌آوری اطلاعات
۴	۶-۱ تعریف مفاهیم و واژه‌های اختصاصی
۴	۷-۱ نتیجه‌گیری
	فصل دوم: مروری بر تحقیقات انجام شده
۵	۱-۲ مقدمه
۶	۲-۲ اثر شوک‌های نفتی بر متغیرهای اقتصادی
۷	۳-۲ آثار قیمت نفت بر اقتصاد
۸	۱-۳-۲ آثار افزایش قیمت نفت بر اقتصاد
۱۰	۲-۳-۲ آثار کاهش قیمت نفت بر اقتصاد
۱۰	۴-۲ مروری بر مطالعات انجام شده
۱۰	۱-۴-۲ مقدمه
۱۰	۲-۴-۲ مروری بر مطالعات خارجی
۱۷	۳-۴-۲ مروری بر مطالعات انجام شده در ایران
۲۴	۵-۲ نتیجه‌گیری
	فصل سوم: روند متغیرهای کلان اقتصادی
۲۶	۱-۳ شناخت کمی و بررسی روند متغیرهای کلان اقتصادی مورد استفاده در مدل
۲۷	۱-۱-۳ تولید ناخالص داخلی
۲۹	۲-۱-۳ سرمایه‌گذاری کل
۳۱	۳-۱-۳ کل مخارج دولت
۳۴	۴-۱-۳ مخارج جاری و عمرانی دولت
۳۸	۵-۱-۳ واردات کالاها و خدمات
۴۱	۶-۱-۳ صادرات کالاها و خدمات
۴۳	۷-۱-۳ صادرات نفت
۴۶	۸-۱-۳ صادرات غیرنفتی

- ۳-۱-۹ مصرف بخش خصوصی..... ۴۹
- ۳-۲ روند قیمت نفت ۵۳
- ۳-۲-۱ عواملی که در قیمت نفت خام مؤثر است..... ۵۴
- ۳-۲-۲ علل عدم ثبات و نوسانات شدید قیمت نفت..... ۵۴

فصل چهارم: ساختار الگو و تحلیل اطلاعات

- ۴-۱ روش تجزیه و تحلیل و ساختار الگو..... ۵۷
- ۴-۱-۱ الگو خود همبسته برداری VAR ۵۷
- ۴-۱-۲ انتخاب وقفه بهینه در مدل‌های خود رگرسیونی..... ۵۸
- ۴-۱-۳ الگوی خود رگرسیون برداری هم‌انباشته ساختاری..... ۵۹
- ۴-۱-۴ آزمون هم‌انباشتگی یوهانسون جوسیلیوس..... ۶۰
- ۴-۱-۵ آزمون اثر..... ۶۱
- ۴-۱-۶ آزمون حداکثر مقدار ویژه..... ۶۲
- ۴-۱-۷ توابع واکنش آنی یا ضربه‌ای و تجزیه واریانس در الگوی SVAR ۶۲
- ۴-۲ تصریح مدل و تبیین روابط بلندمدت و کوتاه‌مدت در اقتصاد ایران..... ۶۲
- ۴-۳ نتایج آزمون دیکی فولر تعمیم یافته و همگرایی..... ۶۶
- ۴-۴ نتایج آزمون تعیین مرتبه بهینه..... ۶۸
- ۴-۵ نتایج آزمون اثر و حداکثر مقدار ویژه..... ۷۰
- ۴-۶ نتایج توابع عکس‌العمل آنی (IRFs)..... ۷۳
- ۴-۷ نتایج پارامترهای ساختاری ۷۵

فصل پنجم: نتیجه‌گیری و پیشنهادات

- ۵-۱ مقدمه ۷۷
- ۵-۲ نتایج تحقیق ۷۷
- ۵-۳ پیشنهادات ۷۸
- منابع و مراجع ۸۰
- پیوست ۸۳

فهرست نمودارها

<u>صفحه</u>	<u>عنوان</u>
۲۸.....	نمودار (۱-۳): تولید ناخالص داخلی.....
۲۸.....	نمودار (۲-۳): رشد تولید ناخالص داخلی.....
۳۰.....	نمودار (۳-۳): سرمایه‌گذاری کل.....
۳۰.....	نمودار (۴-۳): نرخ رشد سرمایه‌گذاری کل.....
۳۱.....	نمودار (۵-۳): نسبت سرمایه‌گذاری کل واقعی به تولید ناخالص.....
۳۲.....	نمودار (۶-۳): کل مخارج واقعی دولت.....
۳۳.....	نمودار (۷-۳): نسبت کل مخارج دولت به تولید ناخالص داخلی.....
۳۳.....	نمودار (۸-۳): نرخ رشد مخارج واقعی دولت.....
۳۴.....	نمودار (۹-۳): مخارج جاری دولت.....
۳۵.....	نمودار (۱۰-۳): نسبت مخارج جاری به تولید ناخالص داخلی.....
۳۶.....	نمودار (۱۱-۳): نرخ رشد مخارج جاری.....
۳۷.....	نمودار (۱۲-۳): مخارج عمرانی دولت.....
۳۷.....	نمودار (۱۳-۳): نسبت مخارج عمرانی به تولید ناخالص داخلی.....
۳۸.....	نمودار (۱۴-۳): نرخ رشد مخارج عمرانی.....
۳۹.....	نمودار (۱۵-۳): واردات کالاها و خدمات.....
۴۰.....	نمودار (۱۶-۳): نسبت واردات کالاها و خدمات به تولید ناخالص داخلی.....
۴۰.....	نمودار (۱۷-۴): نرخ رشد واردات کالاها و خدمات.....
۴۱.....	نمودار (۱۸-۳): صادرات کالاها و خدمات.....
۴۲.....	نمودار (۱۹-۳): نسبت صادرات کالاها و خدمات به تولید ناخالص داخلی.....
۴۳.....	نمودار (۲۰-۳): نرخ رشد صادرات کالاها و خدمات.....
۴۴.....	نمودار (۲۱-۳): صادرات نفتی واقعی.....
۴۵.....	نمودار (۲۲-۳): نرخ رشد صادرات نفت.....
۴۵.....	نمودار (۲۳-۳): نسبت صادرات نفت به تولید ناخالص داخلی.....
۴۷.....	نمودار (۲۴-۳): صادرات غیرنفتی واقعی.....
۴۷.....	نمودار (۲۵-۳): نرخ رشد صادرات غیرنفتی.....
۴۹.....	نمودار (۲۶-۳): نسبت صادرات غیرنفتی به تولید ناخالص داخلی.....
۴۹.....	نمودار (۲۷-۳): مصرف بخش خصوصی.....
۵۰.....	نمودار (۲۸-۳): نرخ رشد مصرف بخش خصوصی.....

نمودار (۳-۲۹): نسبت مصرف بخش خصوصی به تولید ناخالص داخلی..... ۵۰

نمودار (۴-۱): واکنش متغیرها به شوک‌های قیمتی نفت..... ۷۴

نمودار (۴-۲): واکنش تولید ناخالص داخلی به شوک‌های صادرات نفتی و صادرات غیرنفتی..... ۷۵

فهرست جداول

صفحه	عنوان
۱۸.....	جدول (۱-۲): مطالعات خارجی انجام شده در زمینه آثار نوسانات قیمت نفت بر اقتصاد کشورهای صادرکننده نفت.....
۵۲.....	جدول (۱-۳): روند متغیرهای اصلی (۸۶-۱۳۳۸).....
۶۳.....	جدول (۱-۴): معادلات بلندمدت.....
۶۷.....	جدول (۲-۴): آزمون ساکن پذیری متغیرها از روش ADF بدون روند.....
۶۸.....	جدول (۳-۴): آزمون ساکن پذیری متغیرها از روش ADF با روند.....
۷۰.....	جدول (۴-۴): آزمون انتخاب وقفه بهینه.....
۷۱.....	جدول (۵-۴): آزمون اثر برای تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشته مدل.....
۷۱.....	جدول (۶-۴): آزمون حداکثر مقدار ویژه برای تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشته مدل.....
۷۲.....	جدول (۷-۴): تحلیل هم‌انباشتگی سیستم محدود شده.....
۷۵.....	جدول (۸-۴): نتایج برآوردی ضرایب.....

چکیده

نوسانات قیمت نفت اصلی‌ترین منبع نوسانات اقتصادی کشورهای تولیدکننده نفت می‌باشند. در ایران، نفت به عنوان یک ماده حیاتی عمده‌ترین منبع درآمد کشور را تشکیل می‌دهد. جهت جلوگیری از بروز بحران‌های اقتصادی و طراحی سیاست‌های مناسب به منظور حفظ تعادل و ثبات اقتصادی، بررسی اثرات تغییر در قیمت‌های نفت بر روی متغیرهای کلان اقتصادی بسیار ضروری می‌باشد. همچنین تکیه برنامه‌ریزی اقتصادی بر تعیین رشد مشخصی از تولید ناخالص داخلی، لزوم شناخت ارتباط کمی میان نوسانات قیمت نفت و رشد اقتصادی را بیشتر می‌کند.

در این تحقیق با کمک داده‌های سالانه طی دوره ۱۳۸۶-۱۳۳۸ به بررسی اثرات نوسانات قیمت نفت بر رشد اقتصادی، در کنار دیگر متغیرها نظیر سرمایه‌گذاری کل، مخارج جاری دولت، مخارج عمرانی دولت، صادرات نفت، صادرات غیرنفتی، واردات کل و مصرف بخش خصوصی در ایران به صورت مدلی پویا و سیستمی با استفاده از مدل خود توضیح برداری ساختاری (SVAR) و توابع عکس‌العمل آنی (IRFs) و پرداخته شده است.

نتایج تحقیق نشان می‌دهد که در بلندمدت نوسانات قیمت نفت تأثیر منفی بر تولید ناخالص داخلی و صادرات نفت داشته است در حالی که این اثر بر واردات کالاها و خدمات، مصرف بخش خصوصی و سرمایه‌گذاری مثبت بوده است. در کوتاه‌مدت تأثیر نوسانات قیمت نفت بر تولید ناخالص داخلی، مصرف بخش خصوصی، سرمایه‌گذاری، صادرات نفت، واردات کالاها و خدمات، مخارج جاری دولت و مخارج عمرانی دولت مثبت است ولی صادرات غیرنفتی تأثیرپذیری منفی را نشان می‌دهد. در مقایسه، در بلندمدت شدت اثرگذاری نوسانات قیمت نفت به ترتیب بر تولید ناخالص داخلی، واردات کالاها و خدمات، مصرف بخش خصوصی، سرمایه‌گذاری و صادرات نفت است، در صورتی که در کوتاه‌مدت نیز شدت اثرگذاری نوسانات قیمت نفت به ترتیب بر مصرف بخش خصوصی، مخارج جاری دولت، سرمایه‌گذاری، مخارج عمرانی دولت، تولید ناخالص داخلی، صادرات نفت، واردات کالاها و خدمات و صادرات غیرنفتی است.

کلمات کلیدی: نوسانات قیمت نفت، رشد اقتصادی، مدل خود توضیح برداری ساختاری

فصل اول

کلیات تحقیق

۱-۱ مقدمه

رشد اقتصادی کندتر کشورهای با وفور منابع طبیعی در مقایسه با کشورهای فقیر از نظر منابع طبیعی و وجود رابطه منفی بین وفور منابع طبیعی و رشد اقتصادی در دوره های اخیر یک معمای اقتصادی تلقی می شود. وفور منابع طبیعی که در صادرات منابع طبیعی نمود می یابد، می تواند باعث افزایش صادرات و درآمدهای ارزی در اقتصادهای بهره مند از منابع طبیعی شود. بنابراین انتظار می رود، این کشورها از رشد اقتصادی بالایی برخوردار باشند. ولی در واقع چنین نیست! درباره این پدیده توضیحات مختلفی ارائه شده است، ولی در این مورد یک نظریه با پذیرش همگانی وجود ندارد (ساکس و وارنر ۲۰۰۱).

کندی رشد اقتصادی کشورهای صاحب منابع طبیعی و عملکرد بهتر کلان اقتصادی کشورهای فقیر از نظر منابع طبیعی پدیده ای غیرمنتظره در ادبیات توسعه اقتصادی به شمار می رود. اقتصادهای نفتی در چند دهه اخیر با وجود کسب درآمدهای ارزی فراوان از رشد اقتصادی بالا و پایدار برخوردار نبوده اند. از سوی دیگر هنگ کنگ، سنگاپور، تایوان و کره جنوبی بدون منابع طبیعی عملکرد کلان اقتصادی خوبی داشته اند.

بدینی درباره توسعه اقتصادی مبتنی بر منابع طبیعی از پیش بینی درباره تقاضا و روند نزولی و پرنوسان قیمت های جهانی منابع طبیعی نتیجه می شود. مطالعات نشان می دهد کند بودن رشد اقتصادی کشورهای صاحب منابع طبیعی حتی پس از کنترل روند قیمت های جهانی این منابع یک حقیقت تجربی است. بسیاری از کشورهای فقیر هنوز از منابع طبیعی سرشاری برخوردارند، بنابراین بررسی دلایل شکست توسعه اقتصادی مبتنی بر وفور منابع طبیعی برای سیاست گزاران و اقتصاددانان اهمیت می یابد.

۲-۱ ضرورت تحقیق

نفت از اوایل قرن بیستم مصرف صنعتی یافت و از حد نفت چراغ پا فراتر نهاد و به تدریج در اثر برنامه‌ریزی‌های شرکت‌های نفتی جهان و توسعه حمل و نقل مقام پراهمیتی در تامین انرژی بدست آورد.

نفت به عنوان یکی از مهمترین منابع طبیعی و انرژی در جهان به شمار می‌آید که خیلی از فعالیت‌های اقتصادی وابسته به این ماده حیاتی می‌باشد. از آنجایی که نوسانات قیمت نفت بر کلیه متغیرهای کلیدی اقتصاد به ویژه نرخ رشد اثر دارد لذا تغییرات قیمت آن نیز برای اقتصاد جهانی حائز اهمیت می‌باشد.

خیلی از صنایع بزرگ کشورهای توسعه یافته صنعتی به این ماده حیاتی وابسته هستند. لذا نفت بعنوان یک ماده مهم وارداتی برای کشورهای واردکننده آن در تابع واکنش واردات آن‌ها وارد می‌شود از اینرو تغییرات قیمت نفت بر تابع واکنش واردات آن‌ها اثر دارد و از این کانال تراز تجاری و در نهایت تولید ناخالص داخلی آن کشورها تحت تأثیر قرار می‌دهد.

ایران نیز همچون سایر اعضای اوپک در سال ۱۹۷۳ درآمدی سرشاری را که از افزایش یکباره قیمت نفت ناشی شده بود به دست آورد. که این نشان دهنده این است که وابستگی کشور ما به درآمدهای نفت بسیار بالاست [۱].

ایران از جمله کشورهایی است که اساس اقتصاد آن بر درآمد صادرات نفت و گاز بنا شده است. ارتباط حجم و ارزش صادرات نفت و گاز و رشد اقتصادی به منزله افزایش ظرفیت‌های اقتصادی یکی از موضوعات مهم و قابل توجه برای مراکز تحقیقاتی و برنامه‌ریزی است. تکیه برنامه‌ریزی اقتصادی بر تعیین رشد مشخصی از تولید ناخالص ملی، لزوم شناخت ارتباط کمی میان صادرات نفتی و رشد اقتصادی را بیشتر می‌کند.

اقتصاددانان کلاسیک تجارت را "موتور رشد و توسعه" می‌دانستند. نظریه پردازان اقتصادی به منافع متعدد تجارت خارجی و اثر آن‌ها بر توسعه و رشد اقتصادی اشاره دارند. صادرات در تشکیل و انباشت سرمایه در کشور نقش ویژه‌ای دارد. درآمدهای نفتی می‌تواند شکاف میان پس‌انداز ملی و سرمایه‌گذاری مورد نیاز را پر کند و توسعه اقتصادی را تسریع بخشد. بنابراین شناخت میزان تاثیرگذاری آن بر رشد اقتصادی یک مسأله قابل توجه است.

۳-۱ سؤالات تحقیق

پرسش‌های اصلی در این تحقیق عبارتند از:

- (۱) آیا نوسانات رشد اقتصادی از نوسانات قیمت نفت پیروی می‌کنند؟
- (۲) آیا سهم تأثیرگذاری صادرات نفتی در اثر نوسانات قیمت نفت در مقایسه با صادرات غیرنفتی بر رشد اقتصادی بیشتر است؟

۴-۱ زمینه یا فرضیه‌های مورد آزمایش

به دنبال سؤال‌های مذکور زمینه‌های زیر مورد آزمون قرار می‌گیرد:

- (۱) رشد اقتصادی تحت تأثیر نوسانات قیمت نفت قرار دارد.

۲) تأثیر نوسانات صادرات نفتی در اثر نوسانات قیمت نفت بر رشد اقتصادی بیش از صادرات غیرنفتی است.

۵-۱ روش تحقیق و جمع آوری اطلاعات

با توجه به تحقیق و نوع موضوع روش گردآوری اطلاعات به صورت کتابخانه‌ای و اسنادی می‌باشد. در این پایان‌نامه با استفاده از داده‌ها و اطلاعات مورد نیاز از گزارش‌ها و تراژنامه بانک مرکزی، سالنامه آماری کشور، سایت‌های اینترنتی و سایر بانک‌های اطلاعاتی جمع‌آوری شده است. این برآورد با استفاده از روش‌های اقتصادسنجی با نرم افزارهای (4.0) Eviews و Excel و اطلاعات سری‌های زمانی سالانه (۱۳۸۶-۱۳۳۸) صورت می‌گیرد.

۶-۱ تعریف مفاهیم و واژه‌های اختصاصی

تولید ناخالص داخلی (Growth Domestic Product): مجموع ارزش‌های افزوده در فعالیت‌های اقتصادی کشور در یک دوره زمانی معین می‌باشد که به قیمت عوامل محاسبه شده است. رشد اقتصادی: افزایش کمی درآمد ملی (تولید ناخالص ملی) یک جامعه طی یک دوره زمانی معین. طبق این تعریف رشد اقتصادی همان رشد درآمد ملی است که به طور معمول از درصد تغییرات درآمد ملی در طی یک دوره بدست می‌آید.

۷-۱ نتیجه‌گیری

در فصل حاضر کلیاتی در مورد این پژوهش ارائه گشت. با مشخص شدن ضرورت موجود برای انجام این مطالعه، در فصل‌های آتی به بررسی دقیق‌تر مسأله خواهیم پرداخت. در فصل دوم، تاریخچه نفت و ادبیات موضوع و مروری بر مطالعات انجام شده ارائه می‌شود. روند متغیرهای اقتصادی استفاده شده و قیمت نفت، در فصل سوم آورده می‌شود و روش تحقیق و الگو با توجه به آمارهای سری زمانی کشور، در فصل چهارم برای ایران برآورد خواهد شد. در نهایت در فصل پنجم برآورد بدست آمده مورد تجزیه و تحلیل قرار می‌گیرد و پیشنهاداتی ارائه می‌شود.

فصل دوم

مروری بر تحقیقات انجام شده

۲-۱ مقدمه

نفت و موضوع عواید حاصل از فروش آن و اهمیت این دریافتی‌ها در زندگی کشورهای تولیدکننده آن اهمیت ویژه‌ای را در کشورهای صادرکننده جهان دارد. ولی نفت فقط از نظر تولیدکنندگان آن اهمیت ندارد، چرا که این ماده سیاه نقش مهمی را نیز در زندگی مصرف‌کنندگان دارد و از این‌رو بررسی اقتصاد نفت ضروری به نظر می‌آید. مطرح ساختن تاریخچه تولید نفت و بیان این‌که از چندین هزار سال پیش در چین و در خاورمیانه نفت را می‌شناختند، توضیح این‌که چینی‌ها نفت را به عنوان سوخت با کشتی به مناطق مختلف حمل می‌کردند یا در قرن هجده نفت در طول کناره‌های رود ولگا حمل و نقل می‌شد و یا یادآوری از آتشگاه باکو و آتشکده خوزستان که سابقه بسیار طولانی تاریخی و چندین هزارساله دارند یا آن‌که گفته می‌شود که اول بار ادوین دریک در سال ۱۸۵۹ در پنسیلوانیا نفت یافت، نشان‌دهنده اهمیت نفت می‌باشد [۲].

نفت از اوایل قرن بیستم مصرف صنعتی پیدا کرد و از حد نفت چراغ فراتر رفت و به تدریج در اثر برنامه‌ریزی شرکت‌های نفتی جهان و توسعه و حمل و نقل مقام پراهمیتی در تأمین انرژی به‌دست آورد. مواد انرژی‌زای دیگری در برابر این ماده که هم راحت به دست می‌آمد و هم مصرف آن ساده‌تر و سود حاصل آن نیز برای شرکت‌های دست‌اندرکار نسبت به موارد دیگر عظیم و بی‌کران بود، موقعیت خود را به نفع آن از دست دادند [۳]. برای مطالعه‌ی بیشتر در رابطه با چگونگی شکل‌گیری صنعت نفت می‌توان به مرجع شماره [۲] مراجعه نمود.

۲-۲ اثر شوکهای نفتی بر متغیرهای اقتصادی

کنفرانس ژوئن ۱۹۹۴ بانک جهانی به بررسی مسائل مربوط به بهره برداری از معادن و توسعه اقتصادی مربوط می‌شد در این کنفرانس از متخصصان متعددی دعوت به عمل آمده بود تا رشد ضعیف اقتصادی کشورهای صادرکننده منابع معدنی را به طور تاریخی بررسی کنند. کشورهای در حال توسعه که اقتصادشان بر اساس معدن بود نگران آینده و سرنوشت اقتصادی کشورشان بودند. ترس از بیماری هلندی و بلای منابع بین آنها شایع شده بود و سؤال‌هایشان مربوط به چگونگی اتخاذ سیاست‌های مناسب برای مقابله با این مشکلات می‌شد. این‌ها مربوط به تجربه‌های اقتصادی کشورهای متکی بر درآمدهای نفتی در خلال سال‌های ۱۹۷۰ و ۱۹۸۰ می‌شد. همچنین کتابهای معتبری در این دوره منتشر می‌شد و خبر از خطراتی می‌داد که منتظر کشورهای متکی به منابع معدنی می‌باشد [۱].

کشف منابع طبیعی یا افزایش قیمت کالای صادراتی یک کشور درآمد ارزی را یکباره افزایش می‌دهد. این درآمد تغییراتی را در ساختار اقتصاد کشور به وجود می‌آورد. که هزینه‌های رفاهی خاصی را به همراه دارد. چون اولین بار پس از کشف منابع گاز در هلند این مسئله مورد توجه اقتصاددانان قرار گرفت آن را بیماری هلندی نامیده‌اند [۴]. اثرات منفی حاصل از نوسانات زیاد قیمت‌ها، پیش‌بینی غلط قیمت‌ها و استفاده نادرست از منابع در طی شوک‌های قیمتی همه و همه از عواملی هستند که اثرات افزایش در قیمت نفت را خنثی می‌کنند.

بالاخره صنعت معدن که تا سال ۱۹۷۲ در حاشیه قرار گرفته بود به عنوان یک منبع گرانبهای ثروت اقتصادی برای کشورهای در حال توسعه شناخته شد. قیمت نفت در ژانویه ۱۹۸۰ حدود ۲۲ برابر شد و قیمت طلا از هر اونس ۳۵ دلار به بالاترین سطح خودش ۸۵۰ دلار رسید.

بحران نفتی در دهه‌های اخیر ریشه در شوک‌های نفتی دارد که به دلایل مختلف اتفاق افتاده است. شوک اول نفتی متقارن با جنگ یوم کیپور - تحریم نفت اعراب - است که همزمان با جنگ اعراب و اسرائیل در اکتبر ۱۹۷۳ آغاز شده و منجر به کمبود عرضه نفت در اقتصاد جهان شد.

افزایش قیمت‌های مواد معدنی و علی‌الخصوص نفت در سال‌های بعد از ۱۹۷۰ باعث ایجاد بحث‌هایی در مورد ارزش بهره‌برداری از معادن در توسعه اقتصادی گردید. افزایش قیمت نفت در کشورهای ثروتمند نفتی باعث ایجاد تغییرات ساختاری شدیدی شد. ازدحام شهرنشینی، افزایش تورم، نامتعادل شدن توزیع درآمد، از کنترل خارج شدن مخارج دولت و از دست رفتن ارزش‌های اجتماعی و فرهنگی از جمله عواقب این افزایش در قیمت نفت بود. نفت از این به بعد به عنوان یک مصیبت برای کشورهای صادرکننده آن به حساب می‌آمد چون باعث وابستگی شدید مردم به دولت شده بود. طبیعت سیکل‌های قیمتی مواد معدنی هیچ شباهتی به تجربیات گذشته نداشت و باعث ایجاد نگرانی‌هایی در باره اثرات آن روی رشد اقتصادی گردیده بود. این اثرات منفی تنها به کشورهای صادرکننده نفت محدود نمی‌شود. نانکانی (۱۹۷۹) مدعی بود اکثر کشورهای با اقتصاد متکی بر معدن دارای نرخ‌های نهایی پس‌انداز پایین‌تر، نرخ تورم بالاتر، نرخ رشد کشاورزی کمتر، سهم واردات مواد غذایی و در کل واردات بیشتر و درآمدهای صادراتی بی‌ثبات‌تری نسبت به اقتصادهای غیر معدنی هستند [۵].

شوگ دوم نفتی همراه با انقلاب اسلامی ایران و سپس بروز بحران در روابط ایران و عراق در سال ۱۹۸۰ بود که منجر به کمبود دو میلیون بشکه نفت در بازار نفت شد. اشغال سفارت آمریکا در تهران و واکنش متقابل آمریکایی‌ها به صورت تحریم واردات و معامله نفت ایران به ابعاد مسأله دامن زد. نکته قابل توجه این بود که عامل اصلی بروز بالاترین قیمت‌های نفت در تاریخ پس از جنگ جهانی دوم وقوع انقلاب ایران بود و شروع جنگ عراق علیه ایران نیز سبب تداوم آن شد.

شوگ سوم نفتی همراه با شکست اوپک در کنترل قیمت‌ها بود. تلاش‌های سازمان یافته و هماهنگ کشورهای صنعتی غرب که عمدتاً به هدف کاهش وابستگی به نفت پس از بحران اول آغاز شده بود در دهه ۸۰ به نتیجه رسید و موجب کاهش سهم نفت در مصرف سرانه انرژی کشورهای صنعتی و بالطبع کاهش تقاضای نفت در بازار جهانی گردید. از سال ۱۹۸۲ تا ۱۹۸۵ اوپک تلاش کرد تا سهمیه تولید کشورهای عضو این سازمان را با هدف تثبیت قیمت‌های جهانی نفت پایین آورد. اما در عمل به خاطر عدول کشورهای عضو از سهمیه مشخص شده از جانب سازمان با شکست‌های مکرر مواجه شد. از سال ۱۹۹۰ تا ۱۹۹۷ مصرف جهانی نفت ۶/۲ میلیون بشکه در روز افزایش پیدا کرد. کاهش تولید نفت روسیه نیز در افزایش قیمت‌های این دوره نقش بسزائی داشت بطوری که بین سال‌های ۱۹۹۰ تا ۱۹۹۶ تولید نفت روسیه از حدود ۱۱ میلیون بشکه در روز به کمتر از ۶ میلیون بشکه کاهش یافت. اما افزایش قیمت‌ها به این دلیل که آثار بحران اقتصادی آسیا در سال‌های ۱۹۹۷ و ۱۹۹۸ از جانب اوپک مورد توجه قرار نگرفت به سرعت به پایان رسید.

ایران نیز مانند اکثر کشورهای درحال توسعه دارای اقتصادی متکی بر تولید مواد خام است. این کشور همچون سایر اعضای اوپک در سال ۱۹۷۳ در آمد سرشاری را از افزایش ناگهانی قیمت نفت به دست آورد. وابستگی این گونه کشورها به درآمدهای نفت بسیار بالاست. بر اساس تحقیق کادینگتن (۱۹۸۹) این وابستگی در سال ۱۹۸۶ به طور متوسط ۸۶٪ بود. به همین دلیل درآمد هنگفت یاد شده تمامی اقتصاد این کشورها را تحت تأثیر قرار داد. کشور ایران نیز از این امر مستثنی نبود بلکه به دلیل وابستگی شدیدتر از آن حد متوسط آثار آن بیشتر بوده است. مالکیت انحصاری دولت بر بخش نفت و ثبات نرخ ارز رسمی زمینه‌ای را فراهم کرد تا سیاست‌های نامناسب مالی و تجاری ساختار تولید را تغییر دهد که در نتیجه نه تنها فرصت ناشی از کسب این درآمد برای توسعه از دست برود بلکه کشور در سال‌های بعد با مشکلات پایداری روبرو شود [۱].

۲-۳ آثار قیمت نفت بر اقتصاد

با اندکی تأمل در ساختار اقتصاد کشور خودمان و بقیه کشورهای صادرکننده عمده نفت که وابستگی شدیدی به درآمد حاصل از فروش نفت دارند، این ظن قوت می‌گیرد که منشاء بسیاری از شوک‌های وارده به اقتصاد ناشی از شوک نفتی می‌باشد. در واقع مجموعه روابط و خصوصیات اقتصادی این گونه کشورها به نحوی شکل گرفته که هرگونه شوک نفتی چه شوک قیمتی و چه شوک درآمدی نفت علاوه بر آثار مستقیم خود بر رشد تولید ناخالص داخلی از طریق غیرمستقیم نیز پایه پولی، تراز تجاری و نیز وضعیت توازن بودجه دولت را دست خوش دگرگونی ساخته و از این کانال خود یک سلسله جریانات و تبعات پولی و واقعی را برای اقتصاد کشور به دنبال خواهد داشت [۶]. اثر مستقیم تغییرات قیمت نفت بر

رشد اقتصادی هم برای کشورهای صادرکننده و هم برای کشورهای واردکننده نفت در مرحله اول این است که تغییرات قیمت نفت به ویژه افزایش آن باعث ایجاد شرایط تورمی در اقتصاد می شود که این نیز به نوبه خودش می تواند روند تغییر نرخ های بهره و سرمایه گذاری را تحت تأثیر قرار دهد [۷].

اما نحوه تأثیرپذیری تولید ناخالص داخلی از تغییرات قیمت نفت از طریق غیرمستقیم هم می تواند از کانال تراز تجاری و هم از کانال تراز بودجه باشد. به این نحو که چون نفت به عنوان یک ماده مهم صادراتی برای کشورهای صادرکننده آن و یک کالای مهم وارداتی برای صنایع کشورهای واردکننده آن در توابع واکنش صادرات و واردات آن ها وارد می شود، لذا تغییرات قیمت آن بر توابع واکنش صادرات و واردات آن ها اثر دارد و در نتیجه تراز تجاری و در نهایت تولید ناخالص داخلی را تحت تأثیر قرار دهد.

۲-۳-۱ آثار افزایش قیمت نفت بر اقتصاد

افزایش قیمت نفت اقتصاد جهانی را از طرق مختلف تحت تأثیر قرار خواهد داد که عبارتند از:

۱- افزایش قیمت نفت بر سطوح قیمتی و تورم اثراتی خواهد داشت. اهمیت آن به سیاست های انقباضی پولی و محدوده- ای که مصرف کنندگان خواهان جبران کاهش در درآمدهای حقیقی خود از طریق افزایش دستمزد هستند و تولید کنندگانی که خواهان جبران حاشیه های سود هستند، بستگی خواهد داشت.

به این صورت که افزایش قیمت نفت موجب افزایش قیمت سایر کالاها و خدمات می گردد و افزایش قیمت ها به نوبه خود افزایش دستمزدها را به دنبال خواهد داشت، زیرا کارگران برای مقابله با کاهش درآمدهای واقعی خود دست به اقداماتی خواهند زد، که صاحبان صنایع نیز مجبورند برای پرداخت دستمزدهای اضافی به کارگران قیمت ها را بیش از پیش بالا ببرند. به این ترتیب یک دور جدید تورمی به وجود خواهد آمد. این عکس العمل ها خود می تواند یک مارپیچ دستمزد - قیمت^۱ را به وجود آورد.

در گذشته افزایش قیمت نفت باعث رکود اقتصادی در جهان می شد، زیرا در این حالت کشورهای صنعتی برای مقابله با تورم ناشی از افزایش قیمت نفت سیاست پولی انقباضی بکار می بردند تا از تورم بالا جلوگیری کنند. لذا شدت سیاست پولی انقباضی اعمال شده می تواند شدت تورم ناشی از افزایش قیمت نفت را تحت کنترل خود قرار دهد. گرچه این سیاست ها باعث کاهش تورم می شود اما رکود اقتصادی را عمیق تر می کند. اما اکنون با رشد بهره وری، کنترل تورم از راه های آسان تری امکان پذیر است که یکی از آن ها دخالت دولت در نرخ دستمزدهاست. به این گونه که دولت با بالا نگه داشتن نرخ دستمزد کارگران در شرایط رکودی و یا ثابت نگه داشتن دستمزد واقعی کارگران در شرایط تورمی می تواند آن ها را راضی نگه داشته و بهره وری را از این طریق افزایش دهد.

^۱ - Wage – Price Spiral

۲- یکی دیگر از اثرات افزایش قیمت نفت مختل نمودن بسیاری از فعالیت‌های اقتصادی از جمله کاهش تقاضای جهانی می‌باشد. چون میل به مصرف آن گروهی که درآمد از دست می‌دهند (مصرف کنندگان انرژی) عموماً از میل به مصرف آن گروهی که درآمد به دست می‌آورند (تولید کنندگان انرژی) بیشتر است.

از آنجایی که افزایش قیمت نفت موجب انتقال قسمتی از قدرت خرید مردم کشورهای واردکننده به مردم کشورهای صادرکننده نفت می‌گردد لذا با کاهش قدرت خرید مردم کشورهای مصرف کننده مواجه خواهیم شد. کاهش قدرت خرید مردم به نوبه خود موجب کاهش تقاضا می‌شود. کاهش تقاضا از یک سو و عدم اطمینان نسبت به آینده موجب کاهش سرمایه‌گذاری و تولید و در نهایت موجب توقف بسیاری از فعالیت‌های اقتصادی خواهد شد. با این وجود در کشورهای صادرکننده نفت تقاضا به صورت تدریجی کاهش خواهد یافت.

۳- همچنین افزایش قیمت نفت سبب می‌شود تا شرکای عمده تجاری کشورهای واردکننده با کاهش فعالیت‌های اقتصادی در کشور خود روبه‌رو شوند. هرچند بعضی از این کشورها خود صادرکننده نفت بوده و با افزایش قیمت نفت سودهای قابل توجهی به دست می‌آورند اما کاهش فعالیت‌های اقتصادی و تقاضا در کشورهای واردکننده نفت موجب کسادی بازارهای صادراتی دو کشور مذکور خواهد شد. کسادی بازارهای صادراتی و کاهش سرمایه‌گذاری به علت عدم اطمینان به آینده موجب کاهش فعالیت‌های اقتصادی در این کشورها می‌شود.

۴- افزایش در هزینه تولید کالاها و خدمات در اقتصاد بدلیل افزایش در قیمت نسبی تولید انرژی، بر حاشیه سود^۱ فشار می‌آورد. همانگونه که میزان مصرف نفت در تولیدات کشورهای پیشرفته طی سه دهه گذشته کاهش یافته است، انتظار می‌رود اثرات افزایش قیمت نفت بر عرضه کالاها، از دوره‌های گذشته کمتر باشد.

در کشورهای در حال توسعه که افزایش قیمت نفت در کاهش میزان مصرف نفت در تولیدات تأثیر کمتر داشته است ممکن است افزایش قیمت نفت مانند گذشته عرضه کالاها را کاهش دهد.

۵- افزایش قیمت نفت بر بازارهای مالی هم اثرات مستقیم و هم اثرات غیرمستقیم خواهد گذاشت. تغییرات واقعی و احتمالی در فعالیت‌های اقتصادی، درآمد شرکت‌ها، تورم و سیاست پولی به دنبال افزایش قیمت بر قیمت سهام و اوراق بهادار و نرخ‌های ارزی تأثیر خواهد داشت. اساساً شوک قیمتی نفت اثر مثبت بر نرخ بهره دارد که این نتیجه مؤید این نظریه می‌باشد که افزایش‌های قیمت نفت اغلب نشان‌دهنده شرایط تورمی در اقتصاد هستند که این به نوبه خودش نرخ‌های بهره آینده، انواع سرمایه‌گذاری، بازار سهام و اوراق بهادار را تحت تأثیر قرار می‌دهد [۷].

۶- بسته به مدت پایداری افزایش قیمت نفت، تغییر در قیمت‌های نسبی انگیزه‌هایی را برای عرضه کنندگان انرژی در افزایش تولید و سرمایه‌گذاری و برای مصرف کنندگان نفت در صرفه‌جویی ایجاد می‌کند.

^۱ - Marginal Profit