



2123

01111



دانشکده علوم انسانی

پایان نامه دوره کارشناسی ارشد علوم اقتصادی

رابطه ابزارهای سیاستی دولت با نوسانات اقتصادی ایران

بابک چوبینه

استاد راهنما:

دکتر سید ابراهیم حسینی نسب

استاد مشاور:

دکتر لطفعلی عاقلی کهنه‌شهری

کتابخانه اطلاعات دانشکده علوم انسانی
شهر سوئدگان

۱۳۸۷ / ۱۵ / ۲۵

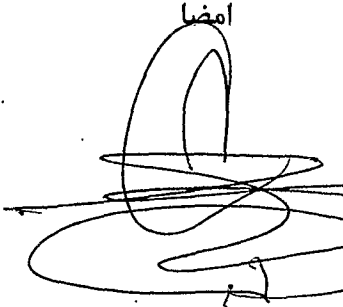
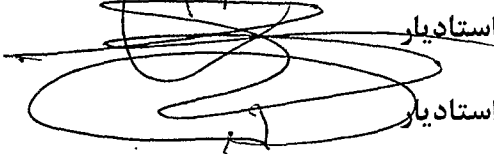



اسفند ۱۳۸۶

۱۰۱۱۷۵

به نام خدا

تاییدیه اعضای هیات داوران در جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد

اعضای هیات داوران نسخه نهایی پایان نامه کارشناسی ارشد آقای بابک چوبینه تحت عنوان "اثر ابزارهای سیاستی مالی و پولی منتخب بر نوسانات اقتصاد کلان در ایران" را از نظر فرم و محتوا بررسی نموده و پذیرش آن را برای تکمیل درجه کارشناسی ارشد پیشنهاد می‌کند.

اعضای هیات داوران	نام و نام خانوادگی	رتبه علمی	امضا
۱- استاد راهنما	دکترسید ابراهیم حسینی نسب	استادیار	
۲- استاد مشاور	دکتر لطفعلی عاقلی	استادیار	
۳- استاد ناظر	دکتر نادر مهرگان	استادیار	
۴- استاد ناظر	دکتر عباس عساری	استادیار	
۵- نماینده تحصیلات تکمیلی	دکتر عباس عساری	استادیار	



بسمه تعالی

آیین نامه چاپ پایان نامه (رساله) های دانشجویان دانشگاه تربیت مدرس

نظر به اینکه چاپ و انتشار پایان نامه (رساله) های تحصیلی دانشجویان دانشگاه تربیت مدرس، مبین بخشی از فعالیتهای علمی - پژوهشی دانشگاه است بنابراین به منظور آگاهی و رعایت حقوق دانشگاه، دانش آموختگان این دانشگاه نسبت به رعایت موارد ذیل متعهد می شوند:

- ماده ۱ در صورت اقدام به چاپ پایان نامه (رساله) ی خود، مراتب را قبلاً به طور کتبی به «دفتر نشر آثار علمی» دانشگاه اطلاع دهد.
- ماده ۲ در صفحه سوم کتاب (پس از برگ شناسنامه)، عبارت ذیل را چاپ کند:
 «کتاب حاضر، حاصل پایان نامه کارشناسی ارشد / رساله دکتری نگارنده در رشته علوم اقتصادی است که در سال ۱۳۸۶ در دانشکده علوم انسانی دانشگاه تربیت مدرس به راهنمایی سرکار خانم / جناب آقای دکتر ابراهیم حسینی، مشاوره سرکار خانم / جناب آقای دکتر لطفعلی عاتقی کهنه چهری و مشاوره سرکار خانم / جناب آقای دکتر - از آن دفاع شده است.»
- ماده ۳ به منظور جبران بخشی از هزینه های انتشارات دانشگاه، تعداد یک درصد شمارگان کتاب (در هر نوبت چاپ) را به «دفتر نشر آثار علمی» دانشگاه اهدا کند. دانشگاه می تواند مازاد نیاز خود را به نفع مرکز نشر در معرض فروش قرار دهد.
- ماده ۴ در صورت عدم رعایت ماده ۳، ۵۰٪ بهای شمارگان چاپ شده را به عنوان خسارت به دانشگاه تربیت مدرس، تأدیه کند.
- ماده ۵ دانشجو تعهد و قبول می کند در صورت خودداری از پرداخت بهای خسارت، دانشگاه می تواند خسارت مذکور را از طریق مراجع قضایی مطالبه و وصول کند؛ به علاوه به دانشگاه حق می دهد به منظور استیفای حقوق خود، از طریق دادگاه، معادل وجه مذکور در ماده ۴ را از محل توقیف کتابهای عرضه شده نگارنده برای فروش، تأمین نماید.
- ماده ۶ اینجانب با تک حورینه دانشجوی رشته علوم اقتصادی مقطع کارشناسی ارشد تعهد فوق و ضمانت اجرایی آن را قبول کرده، به آن ملتزم می شوم.

نام و نام خانوادگی: با تک حورینه

تاریخ و امضا: ۲۸ / ۳ / ۱۳۸۷

دستورالعمل حق مالکیت مادی و معنوی در مورد نتایج پژوهشهای علمی

دانشگاه تربیت مدرس

مقدمه: با عنایت به سیاستهای پژوهشی دانشگاه در راستای تحقق عدالت و کرامت انسانها که لازمه شکوفایی علمی و فنی است و رعایت حقوق مادی و معنوی دانشگاه و پژوهشگران، لازم است اعضای هیأت علمی، دانشجویان، دانش‌آموختگان و دیگر همکاران طرح، در مورد نتایج پژوهشهای علمی که تحت عناوین پایان‌نامه، رساله و طرحهای تحقیقاتی با هماهنگی دانشگاه انجام شده است، موارد ذیل را رعایت نمایند:

ماده ۱- حقوق مادی و معنوی پایان‌نامه‌ها/ رساله‌های مصوب دانشگاه متعلق به دانشگاه است و هرگونه بهره‌برداری از آن باید با ذکر نام دانشگاه و رعایت آیین‌نامه‌ها و دستورالعملهای مصوب دانشگاه باشد.

ماده ۲- انتشار مقاله یا مقالات مستخرج از پایان‌نامه/ رساله به صورت چاپ در نشریات علمی و یا ارائه در مجامع علمی می‌باید به نام دانشگاه بوده و استاد راهنما نویسنده مسئول مقاله باشند. تبصره: در مقالاتی که پس از دانش‌آموختگی بصورت ترکیبی از اطلاعات جدید و نتایج حاصل از پایان‌نامه/ رساله نیز منتشر می‌شود نیز باید نام دانشگاه درج شود.

ماده ۳- انتشار کتاب حاصل از نتایج پایان‌نامه/ رساله و تمامی طرحهای تحقیقاتی دانشگاه باید با مجوز کتبی صادره از طریق حوزه پژوهشی دانشگاه و براساس آئین‌نامه‌های مصوب انجام شود.

ماده ۴- ثبت اختراع و تدوین دانش فنی و یا ارائه در جشنواره‌های ملی، منطقه‌ای و بین‌المللی که حاصل نتایج مستخرج از پایان‌نامه/ رساله و تمامی طرحهای تحقیقاتی دانشگاه باید با هماهنگی استاد راهنما یا مجری طرح از طریق حوزه پژوهشی دانشگاه انجام گیرد.

ماده ۵- این دستورالعمل در ۵ ماده و یک تبصره در تاریخ ۱۳۸۴/۴/۲۵ در شورای پژوهشی دانشگاه به تصویب رسیده و از تاریخ تصویب لازم‌الاجرا است و هرگونه تخلف از مفاد این دستورالعمل از طریق مراجع قانونی قابل پیگیری خواهد بود.

۱۳۸۴/۶/۲۱

تقدیم به:

پدر و مادر بزرگوار و مهربانم

در اینجا لازم می‌دانم از اساتید راهنما و مشاور خود آقایان دکتر سید
ابراهیم حسینی‌نسب و دکتر لطفعلی عاقلی کهنه‌شهری که در تهیه این
پایان‌نامه مرا یاری کردند تشکر کنم. همچنین از داوران این پایان‌نامه آقایان
دکتر عباس عساری و دکتر نادر مهرگان کمال تشکر را دارم. در ضمن از
دوستان عزیزم که با ارائه نظرات سازنده خود مرا کمک کردند، بی‌نهایت
ممنونم.

چکیده:

در این تحقیق سعی شده است که ارتباط بین متغیرهای سیاستی دولت و نوسانات اقتصادی ایران در دوره زمانی زمانی ۱۳۸۴-۱۳۴۰ بررسی شود. ابتدا با استفاده از فیلتر هودریک-پرسکات، جزء چرخه‌های تجاری از متغیر تولید ناخالص داخلی واقعی استخراج شد و سپس با استفاده از شاخص ضریب همبستگی متقابل بین چرخه‌های تجاری و متغیرهای سیاستی نرخ سود تسهیلات بانکی، نرخ مالیات، حجم پول و نرخ سود واقعی معلوم شد که متغیرهای هزینه‌های دولت، نرخ سود واقعی و نرخ مالیات با چرخه‌های تجاری رابطه معنی‌داری دارند ولی نسبت به چرخه‌ها با یک وقفه تاخیر، پسرو می‌باشد، همچنین حجم پول با وجود اینکه متغیری پیشرو نسبت به چرخه‌های تجاری است، دارای ارتباط معناداری با جزء چرخه‌های تجاری نمی‌باشد. از طرف دیگر، با توجه به اینکه نحوه تغییرات GDP دارای اهمیت بسیاری می‌باشد، مدل حاکم بر نرخ رشد GDP با استفاده از مدل ARIMA تخمین زده شد و قدرت پیش‌بینی این مدل با روش هموارسازی نمایی حالت-وینتر مقایسه شد و نتیجه حاصل شد که روش هولت-وینتر نسبت به مدل ARIMA، دارای ثبات بیشتری در پیش‌بینی می‌باشد.

واژگان کلیدی: فیلتر هودریک-پرسکات، نوسانات اقتصادی

فصل اول: مقدمات تحقیق

- ۱-۱- مقدمه ۱
- ۲-۱- تعریف مساله ۳
- ۳-۱- هدف از تحقیق و ضرورت انجام آن ۵
- ۴-۱- فرضیه‌ها ۵
- ۵-۱- روش تحقیق ۶
- ۶-۱- روش جمع‌آوری داده‌ها ۶
- ۷-۱- مفهوم چرخه‌های تجاری ۷
- ۸-۱- ویژگی‌های چرخه‌های تجاری ۸
- ۱-۸-۱- تغییر پذیری ۸
- ۲-۸-۱- تداوم ۹
- ۳-۸-۱- هم حرکتی ۹
- ۹-۱- تغییرات فعالیت‌های اقتصادی ۱۰
- ۱-۹-۱- تغییرات فصلی ۱۰
- ۲-۹-۱- نوسانات چرخه‌ای ۱۱
- ۳-۹-۱- نوسانات تصادفی ۱۲
- ۱۰-۱- انواع چرخه‌های تجاری ۱۲
- ۱-۱۰-۱- چرخه‌های ژوگلار ۱۲
- ۲-۱۰-۱- چرخه کیچن ۱۳
- ۳-۱۰-۱- چرخه کندراتیف ۱۴
- ۴-۱۰-۱- دیدگاه سه چرخه ای شومپیتر ۱۴
- ۵-۱۰-۱- چرخه بلندمدت (قرنی) ۱۵
- ۶-۱۰-۱- چرخه‌های عمده و جزئی ۱۵

فصل دوم: پیشینه نظری و ادبیات موضوع

- ۱-۲- نظریه ارزش و پایه‌های نظری چرخه تجاری آدام اسمیت ۱۷
- ۲-۲- نظریه عمومی مازاد تولید و ارزش ریکاردو ۱۸
- ۳-۲- نظریه چرخه برونزا ۱۹
- ۴-۲- نظریه‌های مدرن چرخه‌های تجاری ۲۰
- ۱-۴-۲- ویکسل و پایه‌های نظریه سیکل پولی ۲۰
- ۲-۴-۲- نظریه پولی خالص یا محض در ارتباط با چرخه تجاری ۲۰
- ۳-۴-۲- نظریه‌های پولی سرمایه گذاری بیش از اندازه در ارتباط با چرخه تجاری ۲۵
- ۴-۴-۲- نظریه‌های غیر پولی سرمایه گذاری بیش از اندازه در ارتباط با چرخه تجاری ۲۶
- ۵-۴-۲- نظریه‌های کمتر مصرف کردن در ارتباط با چرخه تجاری ۲۸

۲۹	۶-۴-۲- نظریه چرخه‌های شومپیتر.....
۲۹	۷-۴-۲- نظریه چرخه‌های وزلی میچل.....
۳۰	۵-۲- مکتب کینز و کینزین‌ها.....
۳۴	۱-۵-۲- نظریه چرخه تجاری هیکس.....
۳۵	۲-۵-۲- نظریه چرخه تجاری متزله.....
۳۶	۳-۵-۲- نظریه چرخه‌های گودوین.....
۳۷	۶-۲- تئوری پولیون.....
۳۸	۷-۲- مکتب چرخه تجاری واقعی.....
۴۰	۸-۲- نظریه انتظارات عقلانی.....
۴۰	۱-۸-۲- نظریه تئوری نئوکلاسیک.....
۴۰	۲-۸-۲- نظریه نئوکینزین‌ها.....
۴۲	۹-۲- مطالعات داخلی انجام شده در زمینه نوسانات اقتصادی.....
۴۸	۱۰-۲- مطالعات خارجی-انجام شده در زمینه نوسانات اقتصادی.....

فصل سوم: مروری بر تحولات اقتصاد ایران

۵۸	۱-۳- اقتصاد ایران در دوره ۱۲۹۵-۱۲۶۵.....
۶۲	۲-۳- اقتصاد ایران در دوره ۱۳۳۸-۱۳۰۰.....
۶۹	۳-۳- وضعیت تولید ناخالص داخلی از سال ۱۳۳۸.....
۷۴	۴-۳- تغییرات اجزای درآمد ملی.....
۷۶	۱-۴-۳- تغییرات تولید ناخالص داخلی و بخش خدمات.....
۷۷	۲-۴-۳- تغییرات تولید ناخالص داخلی و بخش کشاورزی.....
۷۸	۳-۴-۳- تغییرات تولید ناخالص داخلی و بخش صنعت.....

فصل چهارم: روش تحقیق و تحلیل نتایج

۸۲	۱-۴- روش مورد استفاده در تحقیق.....
۸۳	۲-۴- هم‌حرکتی و تغییرات.....
۸۵	۳-۴- روش باکس- جنکینز برای مدل‌سازی سری‌های زمانی.....
۸۶	۱-۳-۴- مرحله اول، تشخیص (شناسایی).....
۸۷	۲-۳-۴- مرحله دوم، تخمین.....
۸۸	۳-۳-۴- مرحله سوم، کنترل تشخیصی.....
۹۰	۴-۳-۴- مرحله چهارم، پیش‌بینی.....
۹۱	۴-۴- روش ساده دیگر برای پیش‌بینی متغیر تک متغیره.....
۹۲	۵-۴- تحلیل نتایج.....
۹۵	۱-۵-۴- آزمون ساکن بودن سری زمانی.....
۹۷	۲-۵-۴- تخمین مدل.....
۹۸	۳-۵-۴- پیش‌بینی مدل.....
۹۸	۴-۵-۴- تحلیل نتایج بر اساس روش هموار سازی.....

۹۹	فصل پنجم: نتیجه‌گیری.....
----	---------------------------

منابع و ماخذ.....	۱۰۳
چکیده انگلیسی.....	۱۰۷

فهرست جداول:

جدول شماره ۱: مطالعات داخلی در زمینه علل نوسانات اقتصادی	۴۷
جدول شماره ۲: خلاصه مطالعات خارجی انجام شده در زمینه نوسانات اقتصادی	۵۷
جدول شماره ۳: نتایج مربوط به رابطه متغیرهای سیاستی با نوسانات تجاری	۹۵
جدول شماره ۴: نتایج آزمون دیکی- فولر	۹۶
جدول شماره ۵: نتایج مربوط به تخمین مدل	۹۷

فهرست شکل‌ها:

شکل شماره ۱: چرخه‌های تجاری	۷
شکل شماره ۲: چرخه‌های ژوگلار	۱۳
شکل شماره ۳: چرخه‌های تجاری شومپیتر	۱۵
شکل شماره ۴: چرخه‌های تجاری از دیدگاه کینز	۳۲
شکل شماره ۵: چرخه‌های تجاری از دیدگاه کینز	۳۳
شکل شماره ۶: چرخه‌های تجاری از دیدگاه پولیون	۳۸
شکل شماره ۷: تغییرات تولید ناخالص داخلی ایران	۷۰
شکل شماره ۸: تغییرات تولید ناخالص داخلی و تولید ناخالص داخلی بدون نفت	۷۱
شکل شماره ۹: تغییرات تولید ناخالص داخلی و ارزش افزوده بخش نفت	۷۶
شکل شماره ۱۰: تغییرات تولید ناخالص داخلی و بخش خدمات	۷۷
شکل شماره ۱۱: تغییرات تولید ناخالص داخلی و بخش کشاورزی	۷۸
شکل شماره ۱۲: تغییرات تولید ناخالص داخلی و بخش صنعت	۸۱
شکل شماره ۱۳: جزء روند بلندمدت	۹۲
شکل شماره ۱۴: جزء چرخه‌ای	۹۳

پیوست:

آزمون ایستایی نرخ GDP	۱۰۷
نمودار خودهمبستگی	۱۰۹
تخمین مدل	۱۱۱
پیش‌بینی	۱۱۲

فصل اول

کلیات

۱-۱ مقدمه

اقتصادهای مدرن معمولاً بین دورانی از رونق و رکود در حرکت می‌باشند. به عبارت دیگر، دورانی وجود دارد که اقتصاد در حال بسط و گسترش بوده و متعاقب آن، وضعیت رکود و کندی را تجربه می‌کند. یک چنین دورانی از رونق اقتصادی که متعاقب آن دوره رکود تجربه می‌گردد، چرخه‌های تجاری^۱ نامیده می‌شود. در خلال دوره رونق، سطح اشتغال و تولید بالا بوده و قیمت‌ها در حال افزایش می‌باشند. در دوران رکود و یا حرکت به سمت رکود، بیکاری افزایش و تولید کاهش یافته و تعدادی از واحدهای تولیدی ممکن است دست از فعالیت بردارند و قیمت‌ها به سمت پایین حرکت می‌کنند. البته یک چنین چرخه‌های اقتصادی نبایستی با نوسانات تجاری اشتباه گرفته شوند: در نوسانات اقتصادی ممکن است نوساناتی در عرضه و یا تقاضا و یا قیمت‌ها در یک بخش بخصوصی از اقتصاد و یا در بخش‌های مختلف اقتصادی به وقوع بپیوندد بدون اینکه ضربه سنگینی به تمامی اقتصاد وارد گردد، در صورتی که در یک چرخه تجاری، تمام بخش‌های مختلف اقتصادی همزمان در حرکت به سمت بالا و پایین تحت تاثیر قرار می‌گیرند که البته در این راستا، بعضی از مناطق جغرافیایی ممکن است نسبت به

^۱ - business cycles

مناطق دیگر بیشتر تحت تاثیر قرار گیرند که این خود بستگی به وضعیت صنایع و یا کشاورزی در آن منطقه دارد.

یک چرخه تجاری معمولاً چندین سال طول می‌کشد تا کامل شود. وقتی که اقتصادی به سمت انقباض و پایین در حرکت است، گفته می‌شود که رکود در حال وقوع است و وقتی که این رکود، عمیق گشته و تداوم یابد، در آن صورت گفته می‌شود که اقتصاد وارد دورانی از بحران شده است. یکی از اقتصاددانانی که در رابطه با چرخه‌های تجاری، مطالعات فراوانی انجام داده است، وزلی میچل^۱ اقتصاددان آمریکایی است که سیکل‌ها را اینگونه تعریف کرده است:

" چرخه‌های اقتصادی نوعی از نوسانات است که در کل فعالیت‌های اقتصادی کشورهایی که اقتصاد خود را عمدتاً بر اساس اقتصاد بازار یا فعالیت آزاد بنگاه‌های تجاری استوار نموده و سازمان داده‌اند، به وجود می‌آیند. یک چرخه شامل دوره‌ای از رونق است که تقریباً همزمان در بسیاری از فعالیت‌های اقتصادی به وقوع می‌پیوندد. این رونق پس از مدتی با یک رکود عمومی و انقباضی در فعالیت‌های اقتصادی همراه می‌گردد که مجدداً پس از مدتی وارد مرحله دیگری از رونق و چرخه بعدی می‌شود. این توالی تغییرات، تکراری است ولی از دوره مشخصی تبعیت نمی‌کند و از این نظر، از لحاظ دوره تداوم زمانی، چرخه‌های اقتصادی از بیش از یک سال تا ۱۰ و ۱۲ سال متغیر است که خود قابل تقسیم به چرخه‌های کوتاهتر با خصوصیات مشابه و نوسانات تقریباً مشابه می‌باشند.^۲

این تعریف همانند بسیاری از تعاریف دیگر که در علوم تجربی مورد استفاده قرار می‌گیرند، به عنوان یکی از ابزارهای تحقیقاتی مورد استفاده قرار گرفته است و البته مانند موارد مشابه خود می‌تواند مورد بازبینی و تجدید نظر قرار گیرد. گروهی دیگر، چرخه‌های اقتصادی را انحراف و دور شدن از یک وضعیت تعادلی و سپس برگشت به سمت یک وضعیت متعارف و عادی

^۱- V. Mitchell

^۲- Mitchell, Vesely. "Measuring Business cycles". NBER, NY. 1947P30

اقتصاد و یا وضعیت تعادلی به حساب می‌آورند. گروهی دیگر بر این باورند که چرخه‌های اقتصادی به وسیله عوامل درونزای درون سیستم ایجاد می‌شود و گروهی دیگر، عوامل برونزا مانند تفاوت‌های ایجاد شده بین نرخ بهره بازار و نرخ طبیعی آن را در ایجاد چرخه‌ها دخیل می‌دانند و به طور کلی، توافق کلی در مورد علل ایجاد چرخه‌ها وجود ندارد.

با توجه به تعاریف بالا و اینکه کشور ما کشوری در حال توسعه است و بخش عمده اقتصاد را دولت تشکیل داده است و برای رسیدن به توسعه اقتصادی، نیازمند ثبات فعالیت‌های کلان اقتصادی است، سیاست‌های دولت می‌تواند نقش فعالی را در حرکت اقتصاد ایفا کند. به همین منظور، در این مطالعه سعی شده است که رابطه ابزارهای سیاستی دولت با چرخه‌های اقتصادی بررسی شود.

۱-۲ تعریف مساله

نوسانات شدید در تولید، اشتغال، قیمت‌ها و سایر جنبه‌های فعالیت‌های اقتصادی اهمیت بسیاری در مسائل اقتصادی، اجتماعی و سیاسی دارند. آنها نه تنها بر کل اقتصاد و اجتماع بلکه بر نحوه زندگی و استانداردهای اشخاص در تمامی سنین و سطوح زندگی اثر می‌گذارد. مشکلات اقتصادی و فشار این مشکلات بر مردم، همیشه وجود داشته است. نوسانات اقتصادی مشکلات را تشدید می‌کند. مثلاً در دوره رکود، تولید کاهش یافته، بیکاری افزایش می‌یابد و اغلب افراد، مشاغل خود را از دست می‌دهند. در دوره رونق نیز به خاطر افزایش تقاضا، قیمت‌ها بالا می‌رود و تورم ایجاد شده بر زندگی مردم اثر می‌گذارد.

کشور ما، یک کشور در حال توسعه محسوب می‌شود که با توجه به پدیده جهانی شدن اقتصاد، باید هر چه سریعتر به توسعه اقتصادی دست پیدا کند. نظریه‌های بسیاری در مورد علل ایجاد نوسانات اقتصادی ارائه شده است. مثلاً پول‌گرایان علت نوسانات اقتصادی را تغییرات حجم پول می‌دانند و برخی مطالعات این نظریه را تایید می‌کنند (چانگ (۲۰۰۱)، یوشیدا (۲۰۰۷) و

کاناوا و دی نوکولو^۱(۲۰۰۳) ولی مطالعات دیگر نشان می‌دهند که عوامل دیگری به غیر از حجم پول در ایجاد نوسانات اقتصادی موثرند به طوری که هاموری(۲۰۰۰)، گاوین(۱۹۹۹) و راپاچ(۱۹۹۸)^۲ که به ترتیب طی تحقیقاتی به بررسی نوسانات اقتصادی ژاپن و آمریکا پرداخته‌اند، نتیجه گرفته‌اند که حجم پول تأثیری بر نوسانات اقتصادی ژاپن و آمریکا ندارد. یکی دیگر از نظریه‌ها، نظریه کینزین‌ها می‌باشد که عوامل طرف تقاضا را در ایجاد نوسانات موثر می‌دانند و برخی از مطالعات نیز آن را تایید می‌کنند(راپاچ(۱۹۹۸)، کاناوا و دی نوکولو(۲۰۰۳)، کانزاک(۲۰۰۴) و دیملیس(۲۰۰۱)^۳. از سویی دیگر مطالعات، بیشتر عوامل پولی و حقیقی را دخیل می‌دانند. مثلاً مهرآرا و نیکی اسکویی(۲۰۰۷) در مقاله مشترکی به تجزیه و تحلیل نوسانات اقتصادی کشورهای صادرکننده نفت پرداخته و شوک‌های طرف عرضه را علت نوسانات اقتصادی معرفی کرده‌اند. همچنین صندوق بین المللی پول (۱۹۹۷) در مطالعه‌ای به مقایسه نوسانات اقتصادی کشورهای آسیایی و آمریکای لاتین پرداخته و نتیجه گرفته است که منبع اساسی نوسانات تولید حتی در کوتاه مدت ناشی از شوک‌های عرضه است. به طور خلاصه، جمع‌بندی این مطالعات در جدول شماره ۲ در قسمت مطالعات خارجی آورده شده است. با توجه به موارد گفته شده، توافق کلی در مورد علل ایجاد نوسانات وجود ندارد.

همانطور که می‌دانیم، یکی از شروط اصلی برای دستیابی به توسعه، ثبات فعالیت‌های اقتصادی است و با توجه به اینکه دولت در اقتصاد ما، نقش فعالی دارد، نقش دولت در ایجاد این ثبات مهم است و سیاست‌های اعمال شده از طرف دولت می‌تواند بر نوسانات اقتصادی اثر بگذارد. از طرفی، متغیرهای سیاستی دولت از جمله نرخ سود بانکی و نرخ مالیات و روش مورد استفاده در این مطالعه، در کشور ما کمتر مورد مطالعه قرار گرفته‌اند. در این مطالعه سعی شده است که

1 -Chang(2001), Yoshida(2007) and Canova and de nicolo(2003)

2-Hamori(2000), Gavin(1999) and Rapach(1998)

3-Kunczuk(2004),Dimelis(2001)

به بررسی ارتباط بین متغیرهای سیاستی دولت و نوسانات اقتصادی ایران بپردازیم و بفهمیم که آیا سیاستهای پولی و مالی دولت در ایجاد نوسانات اقتصادی ایران موثر است یا خیر؟

۳-۱ هدف از تحقیق و ضرورت انجام آن

تولید ناخالص داخلی واقعی^۱ یکی از مهمترین شاخص‌های اقتصادی در یک کشور محسوب می‌باشد. این متغیر غالباً از سیری هموار برخوردار نیست بدین معنی که تولید ناخالص داخلی واقعی حول روند بلندمدت خود دچار نوسانات می‌شود و از آنجائیکه مهمترین هدف اقتصاددانان، کاهش نوسانات اقتصادی و حفظ سطح فعالیت‌های اقتصادی در حد اشتغال کامل می‌باشد، شناخت عوامل موثر در ایجاد چرخه‌های تجاری، قدم اول و اساسی در جهت کنترل نوسانات اقتصادی می‌باشد. از طرفی با توجه به وضعیت اقتصاد ایران و از آنجائیکه در ادبیات اقتصادی ایران، مطالعات زیادی در خصوص چرخه‌های تجاری صورت نگرفته است، مطالعه حاضر با هدف مشخص ساختن ارتباط بین اهم متغیرهای سیاستی دولت و چرخه‌های تجاری و به منظور پرکردن خلا مذکور و دستیابی به نتایج مشخص که بتواند به راهکارهای سیاستی منتهی گردد، طراحی شده است.

۴-۱ فرضیه‌ها

- ۱) حجم پول در ایجاد نوسانات اقتصادی ایران، موثر است.
- ۲) هزینه‌های دولت در ایجاد نوسانات اقتصادی ایران، موثر است.
- ۳) نرخ سود بانکی در ایجاد نوسانات اقتصادی ایران، موثر است.
- ۴) نرخ مالیات در ایجاد نوسانات اقتصادی ایران موثر است.

۱-Real gross Domestic Product

۱-۵ روش تحقیق

روش انجام تحقیق به این صورت می‌باشد که ابتدا متغیر تولید ناخالص داخلی واقعی که متشکل از اجزای روند^۱ و چرخه‌های تجاری می‌باشد را با استفاده از فیلتر هودریک- پرسکات^۲ (HP)، روندزدایی می‌کنیم و جزء چرخه‌های تجاری را استخراج می‌کنیم. تفکیک این اجزاء توسط این فیلتر، در دو مرحله صورت می‌گیرد. در مرحله اول، از این فیلتر جهت استخراج روند بلندمدت استفاده می‌شود و در مرحله دوم، جزء چرخه‌ای از باقیمانده حاصل، استخراج می‌گردد. سپس با استفاده از شاخص ضریب همبستگی متقابل^۳ به بررسی ارتباط بین متغیرهای سیاستی پولی و مالی دولت با جزء ادوار تجاری می‌پردازیم و در پایان، با استفاده از الگوی ARMA، مدل حاکم بر تغییرات GDP را تخمین می‌زنیم و مقدار GDP را پیش‌بینی می‌کنیم.

۱-۶ روش جمع‌آوری داده‌ها

در این تحقیق، مقادیر متغیرهای تولید ناخالص داخلی، نرخ سود بانکی، نرخ مالیات، هزینه‌های دولت و حجم پول به صورت سری زمانی برای سال‌های ۱۳۸۳-۱۳۴۰ با استفاده از مطالعات کتابخانه‌ای از طریق آمارنامه بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، جمع‌آوری شده است. در این مطالعه، حجم پول برابر با مجموع اسکناس و سپرده‌های دیداری و بلندمدت می‌باشد، هزینه‌های دولت شامل هزینه‌های جاری و عمرانی می‌باشد، نرخ مالیات از طریق تقسیم درآمد مالیاتی دولت بر درآمد ملی محاسبه شده است و برای نرخ سود بانکی، به علت نبود آمار در بعضی سال‌ها، از نرخ سود سپرده یک ساله، استفاده شده است.

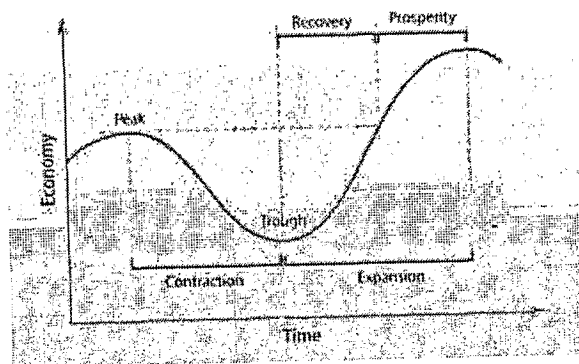
^۱ - Trend

^۲ - Hodrick-prescott

^۳ -Cross Correlation

۷-۱ مفهوم چرخه‌های تجاری

چرخه‌های اقتصادی به عنوان نوسانات فعالیت‌های اقتصادی حول روند بلندمدت تعریف می‌شود و شامل یک دوره رونق نسبی و یک دوره رکود نسبی محصول می‌باشد. این نوسانات با استفاده از تولید ناخالص داخلی واقعی اندازه‌گیری می‌شود. با وجود این، نوسانات اقتصادی الگوی خاصی را دنبال نمی‌کنند.



شکل شماره ۱- چرخه‌های تجاری

از نظر برن و میچل^۱، ادوار تجاری نوساناتی است که در متغیرهای کلان کشورهایی که دارای اقتصاد مبتنی بر بازار هستند مشاهده می‌شود. یک چرخه شامل انقباض و تقریباً در یک زمان در بسیاری از فعالیت‌های اقتصادی به وقوع می‌پیوندد و با رکود، انقباض و تجدید حیات عمومی که در مرحله رونق چرخه بعدی ادغام می‌شود، دنبال می‌گردد. این دنباله تغییرات تکرارشونده است اما دوره زمانی یکسانی ندارد، دوره چرخه‌های تجاری می‌تواند بیشتر از یک تا دوازده سال باشد و قابل تقسیم به چرخه‌های کوچکتر با ویژگی‌های مشابه نمی‌باشد. از نظر آنها، اوج و حوضیض نقاط بحرانی چرخه هستند و از این نظر چرخه را می‌توان به دو

^۱ - Burns and Mitchell

بخش اصلی، مرحله رونق که از حضيض تا اوج ادامه دارد و مرحله رکود که از اوج تا حضيض ادامه دارد، تقسیم کرد.

اقتصاددانان قبل از کینز، اغلب منحنی چرخه‌های تجاری را به صورت سینوسی در اطراف روند نشان می‌دهند. در تحلیل شومپیتر^۱، چهار مرحله برای چرخه وجود دارد:

(۱) رونق (۲) کساد (۳) رکود (۴) بهبود

نیمه بالایی چرخه به دو مرحله رونق و کساد تقسیم می‌شود. در مرحله رونق، افزایش اشتغال با نرخ کاهنده ادامه می‌یابد تا به اوج چرخه می‌رسیم. در مرحله کساد، اشتغال با نرخ فزاینده کاهش می‌یابد تا به نقطه عطف برسیم. از اینجا چرخه به سمت نیمه پایینی حرکت می‌کند. نیمه پایینی به دو مرحله رکود و بهبود تقسیم می‌شود. در طول مرحله رکود، اشتغال با نرخ کاهنده، کاهش می‌یابد تا به نقطه حضيض برسیم. در مرحله بهبود، اشتغال با نرخ فزاینده، افزایش می‌یابد و در مرحله رونق، اشتغال با نرخ کاهنده رشد می‌کند.^۲

۱-۸ ویژگی‌های چرخه‌های تجاری

۱-۸-۱ تغییر پذیری^۳

تغییر پذیری، درجه بی ثباتی یک متغیر را نشان می‌دهد و در واقع میزان تمایل متغیر به نوسان است. سطح بالای تغییر پذیری یک متغیر نسبت به متغیر مرجع، نشانگر توان سری زمانی برای ایجاد چرخه است. برای اندازه‌گیری میزان تغییر پذیری سری‌های زمانی از درصد

2-Schumpeter

2-Robbins.L.,C.1955,"Schumpeters History of economic Analysis,"Quarterly Journal of economics69:1-22

3 -Volatility