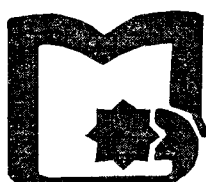


Handwritten signature or calligraphy in Arabic script, possibly reading "عبدالله" (Abdullah).

910VE



دانشگاه سیستان و بلوچستان  
تحصیلات تکمیلی

پایان نامه کارشناسی ارشد  
رشته اقتصاد  
گرایش علوم اقتصادی

عنوان

بررسی رابطه بلندمدت بین تورم و رشد اقتصادی در ایران

استاد راهنما:

دکتر نظر دهمرده

استاد مشاور:

دکتر احمد اکبری

تحقیق و نگارش:

وحید دهباشی

شهریور ۱۳۸۶

۱۳۸۶ / ۱۰ / ۲۱

موسسه اطلاعات دران علمی  
موسسه تحقیقاتی

۹۸ ۵۷۹


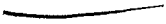

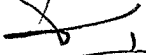


## بسمه تعالی

این پایان نامه با عنوان بررسی رابطه بلند مدت بین تورم و رشد اقتصادی در ایران قسمتی از برنامه آموزشی دوره کارشناسی ارشد علوم اقتصادی توسط دانشجو وحید دهباشی تحت راهنمایی استاد پایان نامه دکتر نظر دهمرده تهیه شده است. استفاده از مطالب آن به منظور اهداف آموزشی با ذکر مرجع و اطلاع کتبی به حوزه تحصیلات تکمیلی دانشگاه سیستان و بلوچستان مجاز می باشد.

(نام و امضاء دانشجو)

وحید دهباشی  
V-P

این پایان نامه ۶ واحد درسی شناخته می شود و در تاریخ ۸۶/۶/۳۱ توسط هیئت داوران بررسی و درجه **۱۹,۲۸** به آن تعلق گرفت.

امضاء	نام و نام خانوادگی	
	دکتر نظر دهمرده	استاد راهنما:
		استاد راهنما:
	دکتر احمد اکبری	استاد مشاور:
	دکتر مصیب پهلوانی	داور ۱:
	دکتر محمد حسین کریم	داور ۲:
	نماینده تحصیلات تکمیلی: <b>تورانی</b>	

همه هرچه هست و نیست، از شماست

بی نفسی شما من هیچ ام  
اگر صدایی و نفسی هست  
اگر قلب و دلی هست

از شماست

با عطر غیب شما از عطرافشانی تمام گلها بی نیازم  
نیاز من بوسیدن دستهای سخاوتمند شماست

**پدر! مادر!**

این کوچک عزیز

رخصت می خواهد که در پیشگاه مهربان شما

بنشیند، زانو بزند و بگوید:

تمام آنچه که بودم، هستم و خواهم بود

همه و همه مدیون شماست

## سپاسگزاری

حمد و سپاس خداوند متعال را که یاری داد تا با موفقیت این پایان نامه را به اتمام برسانم. اکنون بر خود لازم می دانم از زحمات استاد ارجمند جناب آقای **دکتر نظر دهمرده** که راهنمایی پایان نامه اینجانب را بر عهده داشته اند و در جهت ارتقای سطح علمی این پژوهش از هیچ کوشش و راهنمایی دریغ ننموده اند تقدیر و سپاسگزاری نمایم. به یقین بدون مساعدت های ایشان انجام این پایان نامه میسر نمی بود. از استاد محترم مشاور جناب آقای **دکتر احمد اکبری** که با پیشنهادات ارزنده و مقتضی خود در جهت بهبود این پژوهش اینجانب را یاری نمودند، تشکر و قدردانی می نمایم. همچنین از آقای **حسن دهباشی** که در تهیه و گردآوری اطلاعات آماری همکاری داشته و نیز از آقای **حسین دهباشی** به خاطر کمک های بی دریغشان بسیار متشکرم. در نهایت از زحمات تمامی کسانی که به نحوی مرا مورد لطف و محبت خویش قرار داده تا تهیه و تدوین این پژوهش هر چه بهتر صورت گیرد، قدردان و سپاسگزارم.

وحید دهباشی

شهریور ۱۳۸۶

## چکیده

وجود ارتباط بین تورم و رشد اقتصادی در کشورهای مختلف همواره یکی از موضوعات مورد بحث در بین اقتصاددانان بوده است و مباحث تئوریک و تجربی متفاوتی در این زمینه ارائه شده است. بررسی بسیاری از این مباحث نشان می‌دهد که نمی‌توان به یک نتیجه قطعی در مورد تاثیر تورم بر رشد اقتصادی دست یافت و این مسئله در مورد هر کشور به شرایط و ویژگیهای آن کشور بستگی دارد. اما در اکثر مطالعات این نتیجه حاصل شده که تورم در سطوح بالا دارای اثرات منفی و پایدار بر رشد اقتصادی می‌باشد.

پژوهش حاضر در صدد است به بررسی اثرات تورم بر رشد اقتصادی ایران بپردازد و در واقع به دنبال طرح این سوال تدوین می‌شود که پیوند بین تورم و رشد اقتصادی در ایران چگونه است. از آنجائیکه اقتصاد ایران در حال حاضر در مقایسه با کشورهای پیشرفته در هر دو مقوله رشد و تورم با مشکلاتی روبرو است، تحلیل کلی تورم و رشد اقتصادی مفید به نظر می‌رسد.

بر این اساس رابطه بلندمدت بین تورم و رشد اقتصادی برای دوره ۱۳۸۴-۱۳۵۰ به روش الگوی خود توضیح با وقفه های گسترده (ARDL) مورد برآورد قرار گرفته است.

نتایج تجربی مطالعه نشان می‌دهد که اولاً، بین تورم و رشد اقتصادی رابطه با ثبات و تعادلی بدست می‌آید. ثانیاً، رابطه بین دو متغیر بصورت منفی می‌باشد. ثالثاً، برآورد الگوی تصحیح خطا حکایت از سرعت تعدیل بالا این رابطه به سمت مقادیر بلندمدت دارد.

## کلید واژگان

تورم / رشد اقتصادی / رابطه بلندمدت / الگوی خود توضیح با وقفه های گسترده

## فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول: کلیات تحقیق
۲	مقدمه
۳	۱-۱ بیان مسئله
۴	۱-۲ فرضیات تحقیق
۴	۱-۳ هدف و ضرورت تحقیق
۵	۱-۴ متدولوژی تحقیق
۵	۱-۵ شیوه جمع آوری اطلاعات
۶	۱-۶ پیشینه تحقیق
۷	۱-۷ جدول زمانی مراحل اجرا، پیشرفت و دفاع از پایان نامه
۹	فصل دوم: تورم و ابعاد آن
۱۰	۲-۱ تورم
۱۱	۲-۲ تعریف تحلیلی تورم
۱۱	۲-۳ آثار تورم
۱۱	۲-۳-۱ اثر توزیع درآمد
۱۲	۲-۳-۲ اثر رشد و توسعه اقتصادی
۱۶	۲-۳-۳ اثر پس انداز اجباری
۱۸	۲-۴ انواع تورم
۱۸	۲-۴-۱ طبقه بندی تورم براساس منشا یا عامل ایجاد کننده تورم
۱۹	۲-۴-۱-۱ تورم ناشی از فزونی تقاضا
۱۹	۲-۴-۱-۲ تورم ناشی از فشار (افزایش) هزینه تولید
۱۹	۲-۴-۲ طبقه بندی تورم بر مبنای درجه شدت تورم
۱۹	۲-۴-۲-۱ تورم خفیف
۱۹	۲-۴-۲-۲ تورم شدید
۱۹	۲-۴-۲-۳ تورم بسیار شدید
۱۹	۲-۴-۳ طبقه بندی تورم بر مبنای نسبت افزایش قیمتها با افزایش حجم پول
۱۹	۲-۴-۳-۱ تورم باز (تورم آشکار)

۱۹	۲-۳-۳-۲ تورم مهار شده (تورم بسته)
۲۰	۲-۴-۲ طبقه بندی تورم بر مبنای متناوب یا عارضه ای بودن افزایش قیمت‌ها
۲۰	۲-۴-۴-۱ تورم ادواری
۲۰	۲-۴-۴-۲ تورم تاریخی (عارضه ای)
۲۰	۲-۴-۵ تورم وارداتی
۲۰	۲-۴-۶ تورم بنیانی
۲۰	۲-۵ طرق مقابله با تورم
۲۱	۲-۶ مروری بر روند تورم در اقتصاد ایران
۲۱	۲-۶-۱ قبل از انقلاب
۲۲	۲-۶-۲ بعد از انقلاب
۲۵	۲-۷ خلاصه و جمع بندی
۲۶	فصل سوم: تئوریهای مربوط به رشد اقتصادی
۲۷	۳-۱ مفهوم رشد
۲۸	۳-۲ عوامل رشد
۲۸	۳-۲-۱ عوامل اقتصادی
۲۸	۳-۲-۱-۱ منابع طبیعی
۲۹	۳-۲-۱-۲ تمرکز سرمایه
۳۰	۳-۲-۱-۳ سازمان تولید
۳۱	۳-۲-۱-۴ پیشرفت های تکنولوژیک
۳۱	۳-۲-۱-۵ تقسیم کار و مقیاس تولید
۳۲	۳-۲-۱-۶ تغییرات زیربنایی
۳۲	۳-۲-۲ عوامل غیر اقتصادی
۳۲	۳-۲-۲-۱ عوامل اجتماعی
۳۳	۳-۲-۲-۲ عامل انسانی
۳۳	۳-۲-۲-۳ عوامل سیاسی و تشکیلاتی
۳۴	۳-۳ تعریف رشد نوین اقتصادی
۳۴	۳-۳-۱ خصوصیات رشد نوین اقتصادی
۳۶	۳-۴ برخی از تئوریهای رشد
۳۶	۳-۴-۱ مدل‌های رشد هارود و دومار
۳۶	۳-۴-۱-۱ نیازهای رشد یکنواخت اقتصادی
۳۷	۳-۴-۱-۲ فرضیات مدل رشد هارود و دومار



۳۷	۳-۴-۱-۳ مدل دومار
۴۱	۳-۴-۱-۴ انواع نرخهای رشد اقتصادی در الگوی هارود
۴۴	۳-۴-۱-۵ بررسی تطبیقی دو مدل
۴۴	۳-۴-۱-۵-۱ موارد مشابه در مدل
۴۵	۳-۴-۱-۵-۲ موارد اختلاف
۴۶	۳-۴-۲ نظریه رشد اقتصادی در الگوی نئوکلاسیک، الگوی اول
۴۹	۳-۴-۲-۱ مقایسه الگوی رشد اقتصادی سولو با الگوی رشد اقتصادی هارود- دومار
۵۰	۳-۴-۳ نظریه رشد اقتصادی در الگوی نئوکلاسیک، الگوی دوم
۵۳	۳-۴-۴ نظریه های جدید رشد
۵۸	۳-۵ خلاصه و جمع بندی
۵۹	فصل چهارم: مروری بر روند تورم و رشد اقتصادی در ایران
۶۰	۴-۱ پیشینه تورم و رشد اقتصادی در ایران
۷۲	۴-۲ خلاصه و جمع بندی
۷۳	فصل پنجم: پیشینه تحقیق (مباحث نظری و تجربی)
۷۴	۵-۱ مقدمه
۷۴	۵-۲ دیدگاهها
۷۵	۵-۳ مروری بر مطالعات انجام شده
۸۱	۵-۴ خلاصه و جمع بندی
۸۳	فصل ششم: برآورد و تصریح مدل اقتصادسنجی
۸۴	۶-۱ آزمون ریشه واحد برای پایایی
۸۴	۶-۱-۱ آزمون دیکی- فولر تعمیم یافته
۸۶	۶-۲ روش خود توضیح برداری با وقفه های گسترده (ARDL)
۸۸	۶-۳ الگوی تصحیح خطا (ECM)
۸۹	۶-۴ روش تجزیه و تحلیل داده ها
۸۹	۶-۵ معرفی متغیرهای الگو
۹۲	۶-۶ استخراج رابطه بلندمدت
۹۴	۶-۷ استخراج رابطه کوتاه مدت
۹۵	۶-۸ آزمون ثبات و تشخیص
۹۷	۶-۹ خلاصه و جمع بندی

۹۹	فصل هفتم: نتیجه گیری و پیشنهادات
۱۰۰	۷-۱ خلاصه و نتیجه گیری
۱۰۱	۷-۲ یافته های تحقیق
۱۰۲	۷-۳ پیشنهادات
۱۰۳	۷-۳-۱ پیشنهادهای سیاستگذاری
۱۰۳	۷-۳-۲ پیشنهادهای پژوهشهای آتی
۱۰۴	فهرست منابع و مآخذ
۱۰۴	منابع فارسی
۱۰۶	منابع لاتین
۱۰۸	پیوستها

## فهرست نمودارها

صفحه	عنوان
۱۳	نمودار ۱-۲
۱۷	نمودار ۲-۲
۲۷	نمودار ۳-۱
۶۶	نمودار ۱ نرخ تورم و رشد دوره ۱۳۴۰-۱۳۵۳
۶۷	نمودار ۲ نرخ تورم و رشد دوره ۱۳۵۴-۱۳۵۸
۶۸	نمودار ۳ نرخ تورم و رشد دوره ۱۳۵۹-۱۳۶۷
۶۹	نمودار ۴ نرخ تورم و رشد دوره ۱۳۶۸-۱۳۷۶
۷۰	نمودار ۵ نرخ تورم و رشد دوره ۱۳۷۷-۱۳۸۴
۷۱	نمودار ۶ نرخ تورم و رشد دوره ۱۳۵۰-۱۳۸۴
۷۴	نمودار ۱-۵
۹۷	نمودار ۱-۶

## فهرست جداول

صفحه	عنوان
۸	جدول زمانبندی اجرای طرح
۶۴	جدول ۱-۴ حرکات و شاخص تورم طی ادوار مختلف
۶۴	جدول ۲-۴ حرکات و شاخص رشد اقتصادی طی ادوار مختلف
۶۵	جدول ۳-۴ حرکات و ضرایب همبستگی تورم و رشد اقتصادی طی ادوار مختلف
۹۱	جدول ۱-۶ مقادیر آماره ADF و مقادیر بحرانی
۹۱	جدول ۲-۶ مقادیر آماره PP و مقادیر بحرانی
۹۲	جدول ۳-۶ تعیین متغیرهای مانا و نامانا
۹۳	جدول ۴-۶ ضرایب بلندمدت تخمین زده شده با روش ARDL
۹۴	جدول ۵-۶ ضرایب کوتاه مدت تخمین زده شده با روش ARDL
۹۶	جدول ۶-۶ آزمونهای تشخیص

فصل اول  
کلیات تحقیق

با توجه به اهمیت رشد اقتصادی در پیشرفت جوامع بررسی عواملی که بر رشد اقتصادی اثر می گذارند از اهمیت خاصی برخوردار است. مرور ادبیات مربوط به رشد اقتصادی حاکی از آن است که عوامل متعددی می تواند بطور مستقیم و غیرمستقیم بر رشد اقتصادی اثرگذار باشند. سرمایه، نیروی کار و پیشرفت تکنولوژی مهمترین عواملی هستند که بطور مستقیم رشد اقتصادی را در پی خواهد داشت، اما در این بین عواملی مانند تورم نیز وجود دارد که بطور غیرمستقیم رشد اقتصادی را تحت تاثیر قرار می دهد. نظریات مربوط به سیاستهای پولی، نیز دیدگاههای متفاوتی را در خصوص نقش پول در ایجاد تورم و تاثیر آن بر رشد اقتصادی بیان نموده اند: بطوریکه از یک جنبه تورم را محرک رشد اقتصادی و عاملی مثبت در نظر می گیرند ولی از جنبه دیگر آن را بازدارنده رشد اقتصادی و عامل منفی می پندارند. جنبه مثبت تورم بیان می کند که اگر تورم ملایم بر اقتصاد کشور حاکم باشد این افزایش قیمتها منجر به افزایش سود برای کارفرما می گردد، در نتیجه کارفرما برای کسب سود بیشتر تقاضای نیروی کار خود را بالا می برد و تولید افزایش می یابد که در نهایت این افزایش تولید در سطح ملی منجر به رشد اقتصادی می گردد. اما در جنبه منفی، تورم در یک کشور ممکن است به شکل گیری انتظارات تورمی منجر گردد که در این صورت به تورم شدید تبدیل می گردد و مقدمات رکود اقتصادی را فراهم می نماید. همانطور که قیمتها سالانه ۳٪ الی ۴٪ افزایش می یابد مصرف کنندگان و تولیدکنندگان پیش بینی می کنند که قیمتها در آینده با نرخ بیشتری افزایش می یابد از اینرو ذخیره های خود را بجای آنکه در بانکها نگهداری کنند خرج می کنند تا از تورم بیشتر در آینده مصون بمانند. در این وضعیت تورم، مصرف را غیرمنطقی می کند و رفتار پس اندازکنندگان را تغییر می دهد. افراد با درآمد خود و یا حتی اخذ وام هر کالایی را می خرند چه به آن نیاز داشته باشند و چه بی نیاز باشند زیرا نگهداری پول را عاقلانه فرض نمی کنند. محیط تورمی در رفتار پس اندازکنندگان تغییرات اساسی می دهد و آنها را ترغیب می کند به سرمایه گذاریهای کاذب بجای پس انداز کردن روی آورند که قدرت و میل به پس انداز تضعیف می گردد و منابع در دسترس را برای تراکم سرمایه کاهش می دهد و با افت نرخ سرمایه گذاری در بلندمدت اقتصاد تدریجا به طرف رکود حرکت می کند. بنابراین بررسی تجربی و نظری رابطه بین تورم و رشد اقتصادی می تواند از این جهت حایز اهمیت باشد که هم به نقد نظریات مختلف راجع به ارتباط بین این دو متغیر اقتصادی بپردازد و هم آزمون تجربی این رابطه می تواند این نظریات را به محک آزمایش بگذارد. پایان نامه حاضر

در صدد است به بررسی اثرات تورم بر رشد اقتصادی ایران بپردازد و در واقع به دنبال طرح این سوال تدوین می شود که پیوند بین تورم و رشد اقتصادی در ایران چگونه است و از آنجائیکه اقتصاد ایران در حال حاضر در مقایسه با کشورهای پیشرفته در هر دو مقوله رشد و تورم با مشکلاتی روبرو است، تحلیل کلی تورم و رشد اقتصادی مفید به نظر می رسد.

برای انجام این پژوهش پس از مطالعه مکتوبات موجود در رابطه با این موضوع به جمع آوری اطلاعات مورد نظر پرداخته شد که به منظور جمع آوری اطلاعات آماری مورد نیاز به مراجع و منابع رسمی کشور (مرکز آمار ایران- بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران) مراجعه گردید و پس از کسب اطلاعات آماری مورد نظر تخمین مدل به کمک شیوه های اقتصاد سنجی صورت گرفته است. برای تخمین مدل از داده های سری زمانی نرخ تورم، نرخ رشد، نسبت مخارج دولت به GDP، نسبت تغییرات صادرات به GDP و نرخ رشد GDP سرانه طی دوره ۱۳۸۴-۱۳۵۰ استفاده گردید. برای تعیین ارتباط میان متغیرها در این مدل روش خود توضیح با وقفه های گسترده بکار گرفته شده است که هم رابطه کوتاه مدت و هم رابطه بلندمدت بین این متغیرها را تعیین کرده است. نتایج حاکی از آن است که تورم هم در کوتاه مدت و هم در بلندمدت اثرات منفی خود را بر رشد نمایان می سازد که بطور مفصل در فصل ششم به این موضوع پرداخته شده است. ناگفته نماند که این تحقیق در هفت فصل گردآوری شده است:

بطوریکه فصل اول دربرگیرنده کلیات تحقیق می باشد، فصل دوم، مفهوم تورم و ابعاد آن را بیان می نماید، فصل سوم در برگیرنده رشد و نظریه های آن می باشد، فصل چهارم، مروری بر تورم و رشد اقتصادی در ایران را شامل می گردد، در فصل پنجم پیشینه تحقیق (مباحث نظری و تجربی) آورده شده است، فصل ششم به تصریح مدل با روش های اقتصاد سنجی می پردازد و در فصل هفتم نتیجه گیری و پیشنهادات بیان گردیده است.

## ۱-۱ بیان مسئله

اهمیت رشد و توسعه اقتصادی، لزوم بررسی عوامل موثر بر آن را ایجاب می کند. وجود ارتباط بین تورم و رشد اقتصادی یکی از موضوعات مورد بحث در بین اقتصاددانان و سیاستگذاران بوده است، زیرا رابطه بین این دو متغیر در کشورهای مختلف نتایج گوناگونی در پی داشته است بطوریکه در برخی کشورها این رابطه مثبت و مستقیم بوده و در برخی دیگر این رابطه بصورت منفی نشان داده شده است. بنابراین توجه به این موضوع و کشف رابطه میان این دو متغیر به سیاستگذاران کمک می نماید که از حربه تورم بصورت صحیح استفاده کرده تا رشد و توسعه اقتصادی

را به دنبال داشته باشد و موجب افزایش سطح رفاه اجتماعی نیز گردد. از طرفی هم می دانیم پول و سیاستهای پولی نقش زیادی در ایجاد تورم علی الخصوص در کشور ایران دارد پس این پژوهش می تواند به اتخاذ سیاستهای پولی مناسب توسط سیاستمداران و دولتمردان کمک نماید تا در رشد اقتصادی کشور اختلال ایجاد نشود.

سال	۱۳۸۰	۱۳۸۱	۱۳۸۲	۱۳۸۳	۱۳۸۴
نرخ رشد	۳/۳	۷/۶	۶/۸	۴/۸	۵/۴
نرخ تورم	۱۱/۳۹	۱۵/۷۶	۱۵/۶۳	۱۵/۲۳	۱۲/۰۶

برای آشنایی مختصر با این بحث آمار و ارقام نرخ تورم و نرخ رشد اقتصادی ایران در طی سالهای ۸۴-۱۳۸۰ نشان داده شده است. همانطور که جدول نشان می دهد نرخ تورم از ۱۱/۳۹ درصد در سال ۱۳۸۰ به ۱۲/۰۶ درصد در سال ۱۳۸۴ و نرخ رشد از ۳/۳ درصد در سال ۱۳۸۰ به ۵/۴ درصد در سال ۱۳۸۴ رسیده است. در این تحقیق ما در پی آن بوده ایم که تاثیر تورم بر رشد اقتصادی در ایران را به طور علمی و دقیق بررسی نماییم تا نتایج آن در اتخاذ تصمیمات و سیاستهای گرفته شده توسط دولتمردان راهنما باشد.

## ۱-۲ فرضیات تحقیق

این پژوهش بر مبنای این فرضیه ها صورت گرفته است:

- ۱- در کوتاه مدت تورم اثر مثبت بر رشد اقتصادی در ایران دارد.
- ۲- در بلندمدت تورم اثر منفی بر رشد اقتصادی در ایران دارد.
- ۳- متغیر تورم (در مقایسه با سایر متغیرهای مدل) بالاترین سهم را در ایجاد نوسانات (بی ثباتی) رشد اقتصادی دارا می باشد.

## ۱-۳ هدف و ضرورت تحقیق

هدف از ارایه این رساله بررسی چگونگی ارتباط بین تورم و رشد اقتصادی می باشد. از یک طرف اهمیت رشد و توسعه اقتصادی لزوم بررسی عوامل موثر بر آن را ایجاب می نماید و از طرف دیگر می دانیم که تورم یکی از

مشکلات اساسی اقتصادی علی‌الخصوص در کشورهای در حال توسعه می‌باشد که عمدتاً اثرات نامطلوبی بر فرآیند رشد و توسعه اقتصادی بر جای گذارده است. به همین دلیل در مطالعه رشد اقتصادی یک کشور بررسی اثرات تورم بر رشد به عنوان یکی از عواملی که رشد اقتصادی را تحت تاثیر قرار می‌دهد می‌تواند زوایای خاصی از رابطه این دو متغیر روشن سازد. همچنین بررسی و یافتن این ارتباط از آن جهت با اهمیت است که می‌تواند به دولتمردان در اتخاذ سیاستهای پولی کمک کند و در نهایت آزمون این ارتباط می‌تواند راهکارهای مفیدی را به سیاستگذاران ارائه کند.

#### ۴-۱- متدولوژی تحقیق

از آنجائیکه داده‌های بکار رفته در این پژوهش سری زمانی می‌باشد و در داده‌های سری زمانی بکارگیری روش‌های معمول اقتصادسنجی مانند روش حداقل مربعات معمولی (OLS) ممکن است با تورش همراه باشد و نتیجه به رگرسیون کاذب بیانجامد بنابراین برای جلوگیری از این مسئله از روش‌های دیگری مانند همجمعی استفاده می‌نماییم. مفهوم اقتصادی همجمعی به این شرح است «وقتی دو یا چند متغیر سری زمانی براساس مبانی نظری با یکدیگر ارتباط داشته باشند تا یک رابطه تعادلی بلندمدت را شکل دهند. هر چند ممکن است خود این سری زمانی دارای روند تصادفی باشد اما در طول زمان یکدیگر را خنثی می‌کند بگونه‌ای که تفاضل بین آنها باثبات باشد.» همجمعی به روش‌های مختلفی از جمله انگل-گرنجر، جوهانسون-جوسیلیوس و روش خود توضیح با وقفه‌های گسترده (ARDL) صورت می‌گیرد. متد ARDL که توسط پروفیسور هاشم پسران اقتصاددان ایرانی طراحی شده است جدیدترین روشی است که برای مباحث همجمعی پیش‌بینی شده است. ویژگیهای خاص روش ARDL موجب گردید تا این روش بر دیگر روشهای ذکر شده ترجیح داده شود که به چند مورد اشاره می‌گردد:

- ۱- قابلیت بالا و آسانی کار با این متد ۲- تعیین رابطه در حالتی که متغیرها مانا، نامانا و یا ترکیبی از هر دو حالت باشند ۳- تعیین وقفه‌های مختلف برای متغیرهای گوناگون و...

#### ۵-۱- شیوه جمع‌آوری اطلاعات

در ابتدا به منظور مرور ادبیات مربوط به تحقیق از اطلاعات مرسوم به روش کتابخانه‌ای استفاده شده است. در مرحله بعد جهت استنباط و آزمون فرضیه‌ها و پاسخ به سوالات، اطلاعات آماری مورد نظر جمع‌آوری شده که بدین منظور به مراجع و منابع رسمی کشور (مرکز آمار ایران- بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران) مراجعه گردید



و در نهایت مدل اقتصاد سنجی برای تعیین رابطه تورم و رشد اقتصادی ارایه شده است. که در قالب آن تجزیه و تحلیل های مورد نظر انجام گرفته است.

#### ۶-۱ پیشینه تحقیق

با توجه به نگرش های مختلف در مورد رابطه تورم و رشد اقتصادی، بررسی تجربی این دو متغیر می تواند سازگاری یا عدم سازگاری هر یک از تئوری های مطرح شده را با توجه به شرایط خاص کشورهای مورد مطالعه نشان دهد. مطالعات انجام شده در این زمینه را می توان به دو دسته عمده تقسیم نمود: دسته اول مطالعاتی را شامل می شود که در آنها از داده ها و اطلاعات چند کشور استفاده شده (به عبارت دیگر داده های ترکیبی استفاده شده است) مطالعات انجام شده توسط دی گریگوریو (۱۹۹۲)<sup>۱</sup>، بارو (۱۹۹۵)<sup>۲</sup>، الکساندر (۱۹۹۷)<sup>۳</sup> و ... از جمله این مطالعات به شمار می روند. دی گریگوریو در یک کار تجربی به بررسی رابطه بین تورم و رشد اقتصادی در ۱۲ کشور آمریکای لاتین طی دوره ۱۹۸۰-۱۹۵۰ پرداخته است و نتیجه می گیرد که تورم بالا یکی از موانع اصلی رشد اقتصادی در طول دوره مورد بررسی بوده است. الکساندر نیز برای بررسی تاثیر تورم بر رشد اقتصادی از یک معادله نئوکلاسیک استفاده می کند و نتیجه می گیرد که تورم و همچنین تغییرات آن تاثیر منفی و معنی داری بر رشد اقتصادی دارند. دسته دوم مطالعات سری زمانی است که در آنها تاثیر تورم بر رشد اقتصادی در یک کشور خاص بررسی می شود. در این مورد به عنوان نمونه به مطالعات جاو و فرانسیسکو (۲۰۰۱)<sup>۴</sup> در مورد اقتصاد برزیل و نیز ژیان مردوخی (۱۳۷۸)، اکبر کمیجانی و محمود علوی (۱۳۷۸) و مشیری و سلطان احمدی (۱۳۸۱) در اقتصاد ایران اشاره نمود. جاو و فرانسیسکو اثر تورم روی رشد و تولید را در دوره زمانی ۱۹۹۵-۱۹۸۰ برای برزیل مورد بررسی قرار داده اند و نتایج حاکی از آن است که تورم در کوتاه مدت اثر منفی روی تولید دارد اما در بلندمدت اثری بر تولید ندارد. ژیان مردوخی رابطه علی میان رشد اقتصادی و تورم را از طریق آزمون علی گرنجر مورد مطالعه قرار داده است و به منظور دستیابی به جهت و نوع رابطه علی مذکور در اقتصاد ایران از آمارهای سری زمانی دوره ۱۳۳۸-۱۳۷۵ استفاده شده است و نتایج نشان می دهد که رابطه بصورت یکسویه و از تورم به رشد است بدین ترتیب که افزایش تورم موجب کاهش رشد اقتصادی می گردد. اکبر کمیجانی و محمود علوی در مطالعه خود اثرات متقابل تورم و رشد اقتصادی را در سه دوره کوتاه مدت، میان مدت و بلندمدت طی دوره ۱۳۷۶-۱۳۴۰ مورد

---

1- DeGregorio (1992)      2- Barro (1995)  
3- Alexander (1997)      4- Joao and Francisco (2001)

بررسی قرار داده اند و نتایج حاکی از آن است که اگرچه تورم در کوتاه مدت رشد اقتصادی محدودی ایجاد می نماید ولیکن در میان مدت و بلندمدت اثرات منفی و مخربی بر رشد اقتصادی خواهد داشت. مطالعه مشیری و سلطان احمدی هم به بررسی رابطه غیرخطی تورم و رشد اقتصادی در ایران پرداخته است و نتایج کار آنها نشان می دهد که تورم تا نرخ ۱۵/۵ درصد اثر معنی داری بر رشد نداشته ولی پس از آن به عنوان یک عامل ضد رشد عمل می کند.

#### ۱-۷ جدول زمانی مراحل اجرا، پیشرفت و دفاع از پایان نامه

جدول زمان بندی مراحل مختلف این پژوهش که در صفحه بعد آورده شده است، نشان می دهد در مجموع نزدیک به ۱۳ ماه در انجام این پژوهش زمان سپری شده است.

### جدول زمانبندی اجرای طرح

ماه‌های یازدهم، دوازدهم، سیزدهم	ماه‌های هشتم، نهم، دهم	ماه‌های چهارم، پنجم، ششم، هفتم	ماه‌های اول، دوم، سوم	عنوان مرحله
				مرحله مرور ادبیات از اطلاعات
				مرحله جمع آوری اطلاعات آماري
				مرحله ارزیابی مدل سنجی
				مرحله دفاع

فصل دوم  
تورم و ابعاد آن