

بسم الله الرحمن الرحيم



دانشگاه مازندران

دانشکده علوم اقتصادی و اداری

پایان نامه دوره کارشناسی ارشد در رشته علوم اقتصادی

موضوع:

اثر تغییرات افزایش قیمت جهانی نفت بر شاخص های قیمت
تولیدکننده و مصرف کننده در ایران: یک تحلیل داده - ستانده

اساتید راهنما:

دکتر نورالدین شریفی

دکتر محمد علی احسانی

نام دانشجو:

مهدی پورمهر

زمستان ۱۳۸۸

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

سپاسگذاری:

حضرت علی (ع) فرمودند:

«مَنْ عَلَّمَنِي حَرْفًا فَقَدْ سَيَّرَنِي عَبْدًا»

با سپاس فراوان از اساتید ارجمند، دکتر نورالدین شریفی و دکتر محمدعلی احسانی که با صبر، حوصله و درایت تمام، بنده را در تدوین این مجموعه یاری کردند.

تقدیم به:

جویندگان دانش، که دانایی را روشنگر راه کمال یافته اند.

چکیده

نفت خام به عنوان یکی از منابع مهم تولید، با دارا بودن مشتقات فراوان نقش مهمی در ساز و کار اقتصاد کشورهای دنیا دارد. از این رو تغییرات در قیمت آن، سهم زیادی در تغییرات قیمت دیگر کالاها و خدمات خواهد داشت. تحقیق حاضر به دنبال بررسی اثر افزایش قیمت جهانی نفت بر شاخص قیمت های تولیدکننده و مصرف کننده داخلی ایران است. این بررسی، در قالب سه سناریوی افزایش ۱۰، ۲۰ و ۳۰ درصدی در قیمت جهانی نفت، تاثیر این تغییر را فقط از طریق شاخص قیمت واردات بر شاخص قیمت های داخلی مطالعه کرده است. به این منظور، ابتدا با استفاده از الگوی خود توضیح برداری (VAR) و داده های سال های ۱۹۸۰-۲۰۰۸ اثر افزایش قیمت جهانی نفت بر شاخص قیمت واردات ایران برای هر یک از گروه کالاها و خدمات مورد بررسی قرار گرفته است. در ادامه، از طریق تحلیل داده - ستانده که با استفاده از جدول داده - ستانده سال ۱۳۸۰ مرکز آمار ایران صورت گرفته است، اثر تغییرات در شاخص قیمت واردات، بر شاخص قیمت های تولیدکننده و مصرف کننده داخلی ایران محاسبه شده است. نتایج نشان می دهد که تحت سه سناریوی فوق، شاخص های قیمت مصرف کننده و تولیدکننده در سال اول پس از افزایش قیمت جهانی نفت، افزایش می یابد.

واژه های کلیدی

نفت، افزایش قیمت نفت، الگوی خود توضیح برداری، تحلیل داده - ستانده.

فهرست مندرجات

صفحه	عنوان
فصل اول - کلیات	
۲	۱-۱- تعریف مسئله
۳	۲-۱- حدود پژوهش
۳	۳-۱- روش پژوهش
۴	۴-۱- سوالات پژوهش
۴	۵-۱- اهداف پژوهش
۵	۶-۱- ساختار پژوهش
فصل دوم - مبانی نظری و پیشینه تحقیق	
۸	۱-۲- مقدمه
۹	۲-۲- مروری بر تغییرات قیمت نفت
۱۱	۳-۲- مطالعه نظری تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های کلان کشورهای واردکننده و صادرکننده نفت
۱۲	۱-۳-۲- مطالعه نظری تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های کلان اقتصادی کشورهای واردکننده نفت
۱۵	۲-۳-۲- مطالعه نظری تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های کلان اقتصادی کشورهای صادرکننده نفت
۲۲	۳-۳-۲- شیوه تاثیر گذاری افزایش قیمت نفت در اقتصاد ایران
۲۵	۴-۲- مبانی نظری انتقال تغییرات نرخ ارز به قیمت های داخلی
۲۸	۱-۴-۲- تاثیر انتقال تغییرات نرخ ارز در راهبردهای قیمت گذاری کالاها
۲۹	۲-۴-۲- انتقال تغییرات نرخ ارز بر قیمت های داخلی
۳۲	۵-۲- مطالعات انجام شده در خصوص تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های مورد مطالعه
۳۳	۱-۵-۲- مطالعات انجام شده در خصوص تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های مورد مطالعه در کشورهای وارد کننده نفت و جهان
۳۷	۲-۵-۲- مطالعات انجام شده در کشورهای صادر کننده نفت
۳۸	۱-۲-۵-۲- مطالعات انجام شده در دیگر کشورهای صادرکننده نفت
۳۹	۲-۲-۵-۲- مطالعات انجام شده در ایران
۴۱	۶-۲- مطالعات انجام شده در خصوص تغییرات نرخ ارز بر شاخص های قیمت داخلی
۴۱	۱-۶-۲- مطالعات انجام شده در خصوص تغییرات نرخ ارز بر شاخص های قیمت داخلی دیگر کشورها
۴۳	۲-۶-۲- مطالعات مربوط به اثر تغییرات نرخ ارز اسمی ایران بر شاخص های قیمت داخلی کشور ایران
فصل سوم - روش شناسی تحقیق	
۴۷	۱-۳- مقدمه
۴۷	۲-۳- مدل پیش بینی لگاریتم نرخ ارز بازار موازی ایران

۵۱	۳-۲-۱- مدل پیش بینی لگاریتم نرخ ارز ایران با استفاده از الگوی خود توضیح برداری
۵۳	۳-۲-۲- آزمون ریشه واحد برای بررسی ایستایی متغیرها
۵۵	۳-۲-۲-۱- آزمون دیکی- فولر
۵۶	۳-۲-۲-۲- آزمون دیکی- فولر تعمیم یافته
۵۷	۳-۲-۳- انتخاب وقفه بهینه مدل خود توضیح برداری نرخ ارز بازار موازی ایران
۵۸	۳-۳- پیش بینی قیمت جهانی کالاها و خدمات
۶۰	۳-۴- روش داده- ستانده
۶۰	۳-۴-۱- تجمیع جدول داده - ستانده
۶۳	۳-۴-۲- مدل پیش بینی قیمت با استفاده از روابط داده-ستانده

فصل چهارم - تجزیه و تحلیل و یافته های تحقیق

۶۹	۴-۱- مقدمه
۷۰	۴-۲- معرفی اطلاعات مورد استفاده در تحقیق
۷۴	۴-۳- تخمین مدل خود توضیح برداری نرخ ارز بازار موازی ایران
۷۴	۴-۳-۱- آزمون ایستایی متغیرها
۷۶	۴-۳-۲- انتخاب وقفه بهینه مدل خود توضیح برداری نرخ ارز بازار موازی ایران
۸۲	۴-۳-۳- تخمین مدل خود توضیح برداری نرخ ارز بازار موازی ایران
۸۴	۴-۳-۴- تجزیه واریانس خطای پیش بینی و تحلیل تابع عکس العمل آنی متغیر نرخ ارز بازار موازی ارز ایران
۸۶	۴-۴- تخمین مدل قیمت جهانی کالاها و خدمات
۸۶	۴-۴-۱- آزمون ایستایی متغیرها
۹۰	۴-۴-۲- انتخاب وقفه بهینه مدل خود توضیح برداری
۹۱	۴-۴-۳- تخمین الگوهای خود توضیح برداری پیش بینی قیمت کالاها و خدمات
۹۵	۴-۵- محاسبه شاخص قیمت تولید کننده و مصرف کننده
۱۰۱	۴-۶- خلاصه و نتیجه گیری فصل

فصل پنجم - نتیجه گیری و ارائه پیشنهادها

۱۰۴	۵-۱- مقدمه
۱۰۴	۵-۲- خلاصه و نتایج تحقیق
۱۰۷	۵-۳- پیشنهادهای تحقیق

فهرست منابع و مآخذ

۱۰۹	منابع فارسی
۱۱۳	منابع لاتین

فهرست پیوست ها

۱۱۹	جدول ۱- آزمون ریشه واحد برای متغیرهای مدل پیش بینی نرخ ارز بازار موازی
۱۲۷	جدول ۲- آزمون ریشه واحد متغیر قیمت جهانی کالاها و خدمات
۱۳۷	جدول ۳- آزمون ریشه واحد متغیر تولید جهانی کالاها و خدمات
۱۴۹	جدول ۴- تعیین تعداد وقفه بهینه الگوی پیش بینی قیمت جهانی کالاها و خدمات
۱۵۵	جدول ۵- نتایج تخمین الگوی VAR برای مدل های پیش بینی نرخ ارز بازار موازی ایران
۱۵۶	جدول ۶- نتایج تخمین الگوی VAR برای مدل های پیش بینی قیمت کالاها و خدمات
۱۷۵	جدول ۷- شاخص قیمت داخلی گروه کالاها و خدمات در قالب سناریوهای تحقیق
۱۷۷	جدول ۸- جدول مقادیر بحرانی آماره های آزمون دیکی فولر تعمیم یافته
۱۷۸	نمودار ۱- نمودارهای اثر یک انحراف معیار تغییر در قیمت نفت بر قیمت جهانی کالاها و خدمات
۱۸۰	چکیده انگلیسی

فصل اول: کلیات

فصل اول: کلیات تحقیق

۱-۱- تعریف مسئله

نفت به دلیل مشتقات فراوانی که دارد، از مهمترین نهاده های واسطه ای در جهان به شمار رفته و تقریباً در تولید همه کالاها و خدمات به طور مستقیم و یا غیرمستقیم به کار می‌رود. نفت کمی بیش از یک سوم انرژی های اولیه جهان را تامین می‌کند. به این ترتیب، نفت به دلیل کاربرد فراوان در تولید کالاها و خدمات، نقش بسیار مهمی در اقتصاد جهانی بازی می‌کند. این کاربرد ها سبب شده است تا بدون نفت، اقتصاد جهانی با مشکل جدی مواجه شود (اداره اطلاعات انرژی، ۲۰۰۷).^۱

علی‌رغم این که اکثر کشورهای اروپایی و آمریکا، بعد از شوک‌های بزرگ نفتی سال ۱۹۷۴ و ۱۹۷۹ در جهت بهینه سازی تکنولوژی‌های خود تلاش‌هایی در جهت کاهش وابستگی تولیدات شان به نفت نموده‌اند. با این حال، نفت همچنان به عنوان یکی از عوامل مهم تولید جهان به شمار می‌رود.

کشور ایران یکی از بزرگترین صادرکنندگان نفت جهان است که حدود ده درصد از کل منابع نفت جهان را در اختیار دارد که از این حیث در رتبه سوم جهان جای گرفته است. با این حال افزایش قیمت جهانی نفت از دو کانال اقتصاد ایران را تحت تاثیر قرار می دهد. اول این که درآمد حاصل از صادرات نفت ایران، همانند دیگر کشورهای عمده صادرکننده آن، منبع مهم درآمدهای ارزی محسوب می‌شود. افزایش درآمدهای ارزی حاصل از فروش نفت، به علت هزینه کرد نادرست آن موجب پیدایش پدیده بیماری هلندی^۲ می گردد که ثمرات آن کاهش توان رقابتی تولیدات داخل با خارج و در نتیجه کاهش فعالیت های اقتصاد بخش های تولید و افزایش قیمت ها می باشد.

^۱ Energy Information Administration

^۲ Dutch Disease

اما از سوی دیگر، افزایش قیمت نفت هزینه‌های تولید را افزایش داده و سبب ایجاد تورم در سطح جهانی می‌شود (روبینی^۳ ۲۰۰۴ و راگوف^۴ ۲۰۰۵). افزایش قیمت جهانی کالاها، سبب بالا رفتن قیمت کالاها و خدمات وارداتی و در نتیجه افزایش شاخص قیمت تولیدکننده و مصرف‌کننده در کشور می‌گردد. به این ترتیب در نتیجه‌ی افزایشی که در اثر بالا رفتن قیمت جهانی نفت، در قیمت کالاهای وارداتی پدید می‌آید این سؤالات در ذهن متبادر می‌شود که در قالب سؤالات و فرضیات تحقیق مورد مطالعه قرار می‌گیرند:

- افزایش قیمت جهانی نفت چه تاثیری بر شاخص قیمت تولیدکننده دارد؟
- افزایش قیمت جهانی نفت چه تاثیری بر شاخص قیمت مصرف‌کننده دارد؟

۱-۲- حدود پژوهش

علی‌رغم اینکه محدوده مکانی این تحقیق کشور ایران است برای بررسی تاثیر افزایش قیمت جهانی نفت بر قیمت جهانی کالاها و خدمات و همچنین نرخ ارز، از اطلاعات جهانی نیز استفاده می‌شود. در خصوص محدوده زمانی این تحقیق، لازم به ذکر است که در این تحقیق از دو دسته اطلاعات آماری بهره گرفته می‌شود. یک دسته از اطلاعات، مربوط به داده‌های سری زمانی ۱۹۸۰-۲۰۰۸ جهانی است. دسته دوم، جدول داده- ستانده سال ۱۳۸۰ کشور ایران می‌باشد.

³ Roubini
⁴ Rogoff

۱-۳- روش پژوهش

روش مورد استفاده در این تحقیق، ترکیبی از دو روش اقتصادسنجی و روش داده-ستانده است. داده های آماری به شیوه کتابخانه ای جمع آوری می شود. مراحل انجام تحقیق بدین صورت است که ابتدا اثر افزایش قیمت جهانی نفت را بر قیمت کالاها و خدمات وارداتی محاسبه می گردد. لذا جهت دسترسی به این هدف، مدل پیش بینی قیمت واردات را که متشکل از دو معادله پیش بینی قیمت جهانی کالاها و خدمات و معادله پیش بینی نرخ ارز اسمی می باشد به کمک روش های اقتصادسنجی برازش می شود.

بعد از محاسبه تاثیر افزایش قیمت جهانی نفت بر قیمت کالاها و خدمات وارداتی، با استفاده از مدل پیش بینی قیمت داده-ستانده، تغییر در شاخص قیمت تولیدکننده و مصرف کنندگان کالاها محاسبه می شود.

۱-۴- سوالات پژوهش:

۱. میزان تاثیر افزایش قیمت جهانی نفت بر شاخص قیمت تولیدکننده ایران چقدر است؟
۲. میزان تاثیر افزایش قیمت جهانی نفت بر شاخص قیمت مصرف کنندگان ایران چقدر است؟

۱-۵- اهداف این پژوهش:

با توجه به این که نوسانات قیمت نفت اصلی ترین منبع خارجی نوسانات اقتصادی کشورهای تولیدکننده نفت می باشد، جهت جلوگیری از بروز بحران های اقتصادی و طراحی سیاست های مناسب به منظور حفظ تعادل و ثبات اقتصادی، بررسی اثرات قیمت های جهانی نفت بر روی شاخص های قیمت داخلی ضروری به نظر می رسد. علاوه بر این، تدوین برنامه های توسعه اقتصادی و اجتماعی و تنظیم بودجه های سالانه کشور مستلزم شناخت و انجام پیش بینی های دقیق از میزان تاثیر گذاری های نوسانات قیمت نفت بر

شاخص‌های قیمت‌های داخلی می‌باشد. به طوری که برنامه ریزان بتوانند به هنگام بروز تکانه‌های نفتی، تاثیر آن را بر شاخص‌های قیمت به حداقل ممکن کاهش داده و سیاست‌های صحیحی اتخاذ نمایند.

به این ترتیب، هدف این پژوهش، تبیین چگونگی و میزان تاثیر افزایش در قیمت جهانی نفت بر شاخص‌های قیمت داخلی شامل سطح قیمت‌های تولیدکننده و مصرف‌کننده در کشور می‌باشد. در این راستا چگونگی تاثیر گذاری افزایش در قیمت جهانی نفت بر قیمت جهانی کالاها و خدمات، از طریق یک مدل اقتصادسنجی مورد مطالعه قرار می‌گیرد. با توجه به ساختار الگو و قابلیت اعمال سیاست‌ها با تغییر متغیرهای برونزا، اثرات افزایش در قیمت جهانی نفت بر شاخص‌های ذکر شده در سناریوهای متفاوت بررسی می‌شود.

۱-۶- ساختار پژوهش

تحقیق حاضر از پنج فصل تشکیل شده است. فصل اول شامل کلیاتی از تعریف مسئله، اهمیت، سوالات، فرضیات و مواردی از این قبیل در مورد موضوع تحقیق می‌باشد. فصل دوم به تحلیل نظری و ادبیات موضوعی تحقیق اختصاص دارد. این فصل شامل مبانی نظری در مورد روابط بین اجزای مدل‌ها و مطالعات تجربی در ارتباط با موضوع تحقیق می‌باشد. روش‌شناسی، موضوع فصل سوم را تشکیل می‌دهد. با توجه به کاربرد دو روش اقتصادسنجی و داده - ستانده در این تحقیق، فصل سوم به ارائه روش‌های مورد استفاده از هریک از این الگوها پرداخته است. فصل چهارم شامل چهار بخش است؛ پس از ارائه کلیاتی در مورد این فصل، معرفی داده‌ها و اطلاعات مورد استفاده در پژوهش، بخش دوم این فصل را تشکیل می‌دهد. بخش سوم، به تخمین مدل پیش‌بینی نرخ ارز بازار موزای ایران با استفاده از روش‌های خود توضیح برداری پرداخته است. بخش چهارم این فصل، به تخمین مدل پیش‌بینی قیمت جهانی کالاها و خدمات اختصاص

دارد. شاخص های قیمت تولیدکننده و مصرف کننده ایران هم به کمک روابط داده - ستانده در بخش پنجم این فصل ارائه شده است. و بالاخره جمع بندی نتایج به دست آمده در فصل های مختلف و ارائه پیشنهادها، پایان بخش این تحقیق می باشد.

فصل دوم: مبانی نظری و پیشینه تحقیق

فصل دوم: مبانی نظری و پیشینه تحقیق

۲-۱- مقدمه

این فصل به مطالعات نظری و تجربی انجام شده در خصوص افزایش قیمت نفت در جهان می پردازد. برای این کار، شوک های پدید آمده در بازار نفت و نتایج حوادث پدید آمده در این بازار را در دهه های اخیر مورد توجه قرار می دهد. مطالعات نظری در خصوص اثرات افزایش قیمت نفت در کشورهای صادرکننده و وارد کننده از دیگر مطالبی است که به منظور نشان دادن اثرات افزایش قیمت نفت به تفکیک کشورهای صادر کننده و وارد کننده و اقتصاد جهانی مورد بررسی قرار می گیرد و بالاخره، مطالعات انجام شده در خصوص افزایش قیمت نفت در جهان به تفکیک کشورهای وارد کننده و صادرکننده و از آن جمله ایران، از نظر خواهد گذشت.

به این ترتیب، این فصل از پنج بخش تشکیل می شود. تغییرات قیمت نفت در دهه های اخیر در بخش آتی مورد مطالعه قرار می گیرد. بخش سوم به بررسی نظری اثرات افزایش قیمت نفت بر متغیرهای کلان به تفکیک کشورهای واردکننده و صادرکننده ی نفت می پردازد. مبانی نظری انتقال تغییرات نرخ ارز به قیمت های داخلی کشورها، بخش چهارم این فصل را تشکیل می دهد. بخش پنجم به مطالعات انجام شده در زمینه افزایش قیمت نفت بر اقتصاد کشورهای واردکننده و صادرکننده از جمله ایران اختصاص دارد. در بخش ششم، به مطالعات انجام شده در خصوص تغییرات نرخ ارز بر شاخص های قیمت داخلی کشورها پرداخته شده است.

۲-۲- مروری بر تغییرات قیمت نفت

تا اوایل دهه ۱۹۷۰ بهای نفت خام پس از دو دهه کاهش مداوم به ۲ تا ۳ دلار در هر بشکه رسید، در حالی که این وضع پس از سال ۱۹۷۳ تغییر زیادی کرد. از نوامبر ۱۹۷۳ تا اولین دوره سه ماهه سال ۱۹۷۴ بهای نفت از ۳/۳ دلار به ۱۳ دلار در هر بشکه رسید. این افزایش قیمت نفت که به شوک اول نفتی معروف شد به واسطه ی جنگ اعراب با اسرائیل اتفاق افتاد که منتج به تحریم صادرات نفت از سوی چند کشور عربی به آمریکا و هلند به عنوان طرفداران اسرائیل گردید. از طرفی سازمان کشورهای تولید کننده نفت (اوپک)^۱ با استفاده از قدرت انحصار چندجانبه، با ممانعت از افزایش تولیدات نفت، زمینه را برای بالا رفتن قیمت نفت فراهم کردند.

کاهش تولیدات اوپک در اواخر سال ۱۹۷۸ که در پی انقلاب اسلامی ایران و به دنبال آن جنگ تحمیلی عراق علیه ایران اتفاق افتاد، دومین تکانه قیمتی نفت را ایجاد نمود. در پی این حوادث قیمت نفت در نوامبر ۱۹۸۰ به سه برابر مقدار اولیه خود یعنی بشکه ای ۳۹ دلار افزایش یافت. با این حال رکود جهانی اوایل دهه ۱۹۸۰ میلادی و تلاش کشورهای صنعتی واردکننده نفت برای صرفه جویی در مصرف انرژی، موجب کاهش نسبی تقاضای جهانی نفت و اشباع بازار آن شد. نتیجه این امر ادامه کاهش تدریجی و سیر نزولی قیمت نفت از اوایل دهه ۱۹۸۰ تا اواخر این دهه بوده است.

آغاز جنگ عراق و کویت در آگوست سال ۱۹۹۰ منجر به حذف سهم تقریباً هفت درصدی تولیدات نفت این دو کشور در جهان شد. این واقعه که به شوک سوم نفتی شهرت یافته است، منجر به افزایش قیمت نفت از بشکه ای ۱۷ دلار به ۳۵ دلار گردید. با این حال این شوک، مدت زیادی دوام نیاورد

^۱ Organisation of Petroleum Exporting Countries (OPEC)

و قیمت نفت در سال ۱۹۹۱ به بشکه ای ۲۰ دلار کاهش یافت و تا اوایل سال ۱۹۹۸ نوسان جزئی را تجربه کرد.

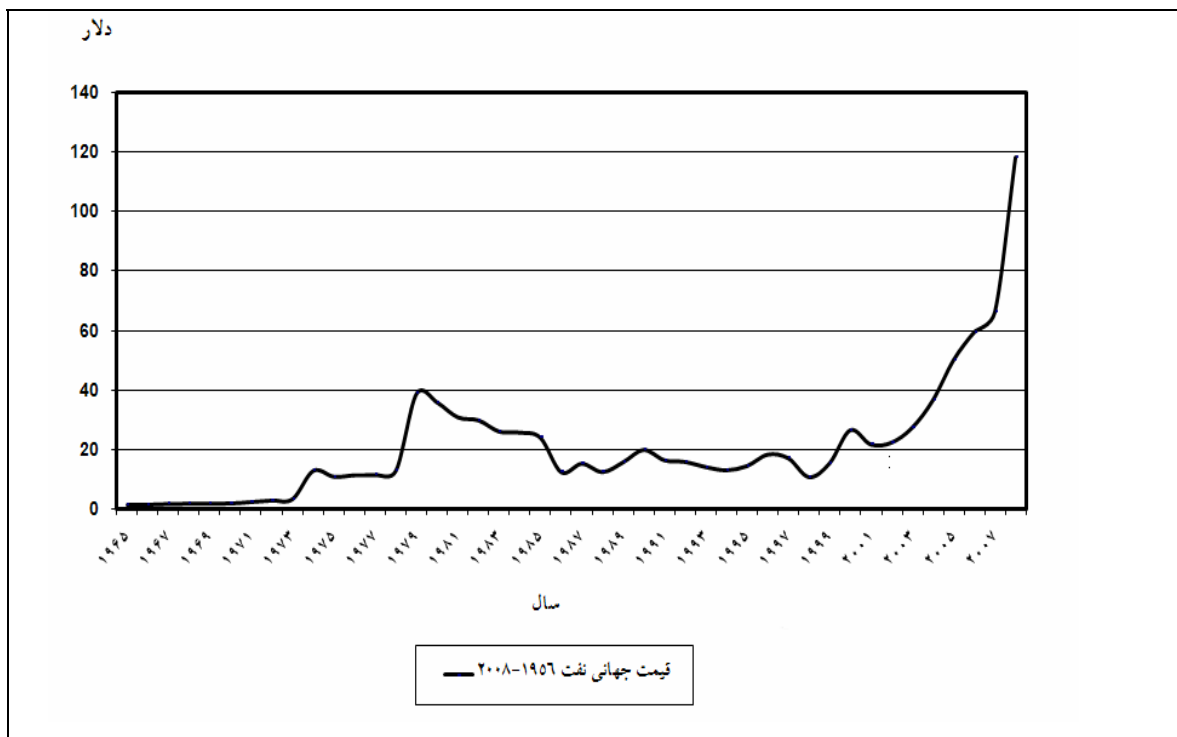
تقاضای نفت به دلیل توسعه بخش تولید در چین و رشد و رونق اقتصادی در آمریکا از اواسط سال ۱۹۹۸ روند افزایشی به خود گرفت که به دنبال آن قیمت این محصول نیز افزایش یافت. در این راستا قیمت نفت از بشکه ای ۱۳ دلار در سال ۱۹۹۸ به ۳۰ دلار در سال ۲۰۰۳ رسید. ادامه رشد و رونق اقتصادی در جهان مخصوصا در چین و آمریکا و عوامل دیگری مانند ناامنی ها در عراق و تاحدی در نیجریه، خسارت های ناشی از طوفان سهمگین کاترینا و ریتا در خلیج مکزیک، موجبات تشدید افزایش قیمت نفت را فراهم نمود به طوری که قیمت آن در یک روند صعودی به بشکه ای ۷۵ دلار در انتهای سال ۲۰۰۶ رسید.

روند صعودی افزایش تقاضای جهانی نفت خام که از سال های قبل شروع شده بود در سال ۲۰۰۷ نیز ادامه یافت. این در حالی بود که ظرفیت مازاد اوپک در کمترین مقدار خود قرار داشت به طوری که رشد تولید نفت در سال ۲۰۰۷ برابر $1/48$ - درصد بوده است که تولید روزانه آن از $31/4$ میلیون بشکه در سال ۲۰۰۶ به $30/1$ میلیون بشکه در سال ۲۰۰۷ رسید. این امر موجب رشد ۷۰ درصدی قیمت ها از حدود بشکه ای ۵۰ دلار در اوایل سال ۲۰۰۶ به بشکه ای ۸۵ دلار در اواخر سال ۲۰۰۷ گردید. افزایش شدید قیمت نفت در سال ۲۰۰۸، به دلیل کاهش چشمگیر ذخیره سازی کشورهای واردکننده نفت و بالا رفتن تقاضا از سوی این کشورها نیز ادامه داشت، به طوری که در طول ۷ ماه، قیمت این محصول از بشکه ای ۹۲ دلار به ۱۴۷ دلار نایل آمد.

با این حال، علیرغم تمام پیش بینی هایی که در ادامه افزایش چشمگیر قیمت نفت می شد، تحولات مهم و اثرگذاری در بازار نفت از قبیل افزایش تولیدات نفت عربستان (خارج از تعهدات اوپک)، افزایش ارزش دلار و بحران مالی آمریکا که منجر به رکود جهانی و کاهش تقاضای نفت گردید، موجبات کاهش ۷۰

درصدی قیمت نفت را فراهم کرد به طوری که قیمت نفت از بشکه ای ۱۴۷ دلار در سه ماهه سوم سال ۲۰۰۸ به ۴۰ دلار در انتهای این سال تنزل یافت.^۲ نمودار شماره (۱-۲)، تغییرات قیمت اسمی نفت در طی سال های ۱۹۶۰ - ۲۰۰۸ در جهان را نشان می دهد.

نمودار (۱-۲): نمودار قیمت جهانی نفت از سال ۱۹۶۰ تا ۲۰۰۸



ماخذ: اوپک، ۲۰۰۹

۲-۳- مطالعه نظری تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های کلان کشورهای واردکننده و

صادرکننده نفت

وجود نفت در جهان، برای صاحبان آن فرصت و درآمد و در مقابل، برای خریداران و واردکنندگان آن (نفت خام و یا فرآورده های نفتی) هزینه محسوب می شود. بنابراین به دلیل تفاوت وضعیت کشورها در

^۲ www.wtrg.com

برخورداری از نفت و تفاوت در عملکرد نفت در اقتصاد آنها، اثر افزایش قیمت نفت بر مکانیسم اقتصادی کشورهای مختلف، متفاوت می باشد. با توجه به این امر، در این بخش، چگونگی تاثیر گذاری افزایش قیمت نفت بر اقتصاد کشورهای وارد کننده و صادر کننده و جهان مورد تجزیه و تحلیل قرار می گیرد.

۲-۳-۱- مطالعه نظری تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های کلان اقتصادی کشورهای واردکننده

نفت

مطالعات فراوانی در زمینه ی اثرات افزایش قیمت نفت بر شاخصهای کلان اقتصادی کشورهای وارد کننده نفت انجام شده است. سیل (۲۰۰۷)^۳ و آژانس بین المللی انرژی (۲۰۰۴)^۴، چگونگی تاثیر افزایش قیمت نفت بر شاخص های کلان اقتصادی این کشورها را مورد توجه قرار داده اند. راگوف (۲۰۰۵)^۵ و روبینی (۲۰۰۴)^۶ نیز دلایل تاثیر نوسانات قیمت نفت بر شاخصهای کلان اقتصادی و چگونگی اثرگذاری آن را در جهان بررسی کرده اند.

بر اساس این مطالعات، افزایش قیمت نفت به طور مستقیم هزینه های تولید و حمل و نقل را افزایش می دهد. از طرفی افزایش ناگهانی نفت، نااطمینانی برای آینده را موجب شده که ممکن است مصرف و سرمایه گذاری های بنگاه ها و خانوارها را به تاخیر اندازد. همچنین تغییرات در قیمت نفت منجر به تخصیص مجدد عوامل تولید بین بخش های انرژی بر و غیر انرژی بر می شود. از این رو افزایش قیمت نفت کاهش معنی داری در رشد اقتصادی را به همراه خواهد داشت.

قیمت نفت عامل تعیین کننده ی مهمی در کارایی اقتصاد جهان به شمار می رود. به طور کلی افزایش قیمت نفت منجر به انتقال درآمد از کشورهای واردکننده به کشورهای صادرکننده، از طریق یک رابطه مبادله

^۳ Sill

^۴ International Energy Agency (IEA)

^۵ Rogoff

^۶ Roubini