

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

به نام خدا

منشور اخلاق پژوهش

با یاری از خداوند سبحان و اعتقاد به اینکه عالم محضر خداست و همواره ناظر بر اعمال انسان و به منظور پاس داشت مقام بلند دانش و پژوهش و نظر به اهمیت جایگاه و دانشگاه در اعتلای فرهنگ و تمدن بشری ، ما دانشجویان و اعضاء هیأت علمی واحدهای دانشگاه آزاد اسلامی متعهد می گردیم اصول زیر را در انجام فعالیت های پژوهشی مدنظر قرار داده و از آن تخطی نکنیم :

- ۱- **اصل برائت :** التزام به برائت جویی از هر گونه رفتار غیر حرفه ای و اعلام موضع نسبت به کسانی که حوزه علم و پژوهش را به شائبه های غیر علمی می آلاینند .
- ۲- **اصل رعایت انصاف و امانت :** تعهد به اجتناب از هر گونه جانب داری غیر علمی و حفاظت از اموال ، تجهیزات و منابع در اختیار .
- ۳- **اصل ترویج :** تعهد به رواج دانش و اشاعه نتایج تحقیقات و انتقال آن به همکاران علمی و دانشجویان به غیر از مواردی که منع قانونی دارد.
- ۴- **اصل احترام :** تعهد به رعایت حریم ها و حرمت ها در انجام تحقیقات و رعایت جانب نقد و خودداری از هر گونه حرمت شکنی .
- ۵- **اصل رعایت حقوق :** التزام به رعایت کامل حقوق پژوهشگران و پژوهیدگان (انسان ، حیوان و نبات) و سایر صاحبان حق .
- ۶- **اصل رازداری :** تعهد به صیانت از اسرار و اطلاعات محرمانه افراد ، سازمان ها و کشورها و کلیه افراد و نهادهای مرتبط با تحقیق .
- ۷- **اصل حقیقت جویی :** تلاش در راستای پی جویی حقیقت و وفاداری به آن و دوری از هر گونه پنهان سازی حقیقت .
- ۸- **اصل مالکیت مادی و معنوی :** تعهد به رعایت کامل حقوق مادی و معنوی دانشگاه و کلیه همکاران پژوهش .
- ۹- **اصل منافع ملی :** تعهد به رعایت مصالح ملی و در نظر داشتن پیشبرد و توسعه کشور در کلیه مراحل پژوهش .

امضاء پژوهشگر :



دانشگاه آزاد اسلامی
واحد تهران مرکزی
دانشکده اقتصاد و حسابداری

پایان نامه برای دریافت درجه کارشناسی ارشد (M.A)
گرایش : علوم اقتصادی

عنوان :

اثر درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی در ایران

استاد راهنما :

دکتر هوشنگ مومنی وصالیان

استاد مشاور :

دکتر محمدرضا میرزایی نژاد

پژوهشگر :

افشین شیخی

پاییز ۱۳۹۱

تقدیم به :

به پدر بزرگوارم؛

که درس صداقت را به عنوان اولین اصل زندگی به من آموخت، او که شمع وجودش روشنی بخش
زندگیم است و هستی ام در آرزوی احیای ذره ای از زحماتش تداوم دارد.

تقدیم...

به مادر مهربانم؛

آفتاب روشنی بخش زندگیم که سعادت را مرهون فداکاری ها و گذشت های بی پایانش می دانم، او
که تمام اجزای وجودم، با مهر و محبتش در هم آمیخته و آنچه دارم از دعای خیر اوست.

تشکر و قدردانی :

برخود لازم می‌دانم که از استاد راهنمای بزرگوام جناب **دکتر هوشنگ مومنی وصالیان** که همواره راهنما و راه گشای اینجانب در انجام این پایان نامه بوده اند تشکر نمایم.

همچنین از **دکتر میرزایی نژاد** به عنوان استاد مشاور، کمال تشکر و سپاسگزاری را دارم.

از خانم **دکتر مرجان دامن کشیده** هم به خاطر قبول داوری پایان نامه اینجانب بسیار سپاسگزارم.

تعهد نامه اصالت پایان نامه کارشناسی ارشد

اینجناب افشین شیخی دانش آموخته مقطع کارشناسی ارشد ناپیوسته به شماره دانشجویی: ۸۹۰۶۳۵۹۱۳۰۰ در رشته: اقتصاد که در تاریخ: ۱۳۹۱/۰۹/۲۶ از پایان نامه خود تحت عنوان: اثر درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی در ایران با کسب نمره ۱۹ و درجه عالی دفاع نموده ام بدینوسیله متعهد می شوم:

۱- این پایان نامه حاصل تحقیق و پژوهش انجام شده توسط اینجناب بوده و در مواردی که از دستاوردهای علمی و پژوهشی دیگران (اعم از پایان نامه، کتاب، مقاله و...) استفاده نموده ام، مطابق ضوابط و رویه های موجود، نام منبع مورد استفاده و سایر مشخصات آن را در فهرست ذکر و درج کرده ام.

۲- این پایان نامه قبلاً برای دریافت هیچ مدرک تحصیلی (هم سطح، پایین تر یا بالاتر) در سایر دانشگاهها و موسسات آموزش عالی ارائه نشده است.

۳- چنانچه بعد از فراغت از تحصیل، قصد استفاده و هر گونه بهره برداری اعم از چاپ کتاب، ثبت اختراع و از این پایان نامه داشته باشم، از حوزه معاونت پژوهشی واحد مجوزهای مربوطه را اخذ نمایم.

۴- چنانچه در هر مقطع زمانی خلاف موارد فوق ثابت شود، عواقب ناشی از آن را بپذیرم و واحد دانشگاهی مجاز است با اینجناب مطابق ضوابط و مقررات رفتار نموده و در صورت ابطال مدرک تحصیلی ام هیچگونه ادعایی نخواهم داشت.

نام و نام خانوادگی: افشین شیخی

تاریخ و امضاء

بسمه تعالی

در تاریخ: ۱۳۹۱/۰۹/۲۶ دانشجوی کارشناسی ارشد آقای افشین شیخی از پایان نامه خود دفاع نموده و با نمره ۱۹ بحروف نوزده و با درجه عالی مورد تصویب قرار گرفت.

امضاء استاد راهنما:

بسمه تعالی
دانشکده اقتصاد و حسابداری

(این چکیده به منظور چاپ در پژوهش نامه دانشگاه تهیه شده است)

نام واحد دانشگاهی: تهران مرکزی	کد واحد: ۱۰۱	کد شناسایی پایان نامه: ۱۰۱۲۰۹۱۵۹۰۲۰۰۴
عنوان پایان نامه: اثر درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی در ایران		
نام و نام خانوادگی دانشجو: افشین شیخی	شماره دانشجویی: ۸۹۰۶۳۵۹۱۳۰۰	رشته تحصیلی: اقتصاد
تاریخ شروع پایان نامه: ۱۳۹۱/۰۹/۲۶	تاریخ اتمام پایان نامه: ۱۳۹۱/۰۹/۲۶	
استاد راهنما: دکتر هوشنگ مومنی وصالیان		
استاد مشاور: دکتر ابراهیم میرزایی نژاد		
آدرس و شماره تلفن: تهران، خیابان امام خمینی، کوچه طباطبایی، بن بست دوم پلاک ۲ واحد ۱. تلفن ۶۶۳۶۷۹۵۸		
چکیده پایان نامه: اثر درآمدهای نفتی بر تورم و نیز رشد اقتصادی همواره از موضوعات مهم و بحث برانگیز در میان اقتصاددانان بوده است. بسیاری از اقتصاددانان از درآمدهای نفتی به عنوان عامل موثر و مفید بر رشد اقتصادی تأیید می کنند در حالیکه دسته دیگر با این فرضیه مخالفت می کنند و آن را به عنوان عامل مخل سیستم اقتصادی میدانند ولی تقریباً همگی از کاهش فشار تورمی آن آگاه بوده و این امر را تصدیق میکنند. نتایج حاکی از مطالعات متعدد در این زمینه متفاوت از یکدیگر بوده و هیچ کدام این فرضیات را به صورت قطعی تأیید نمی کنند. هدف از این تحقیق نیز بررسی اثر درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی در ایران می باشد. در همین راستا رشد اقتصادی، تورم، تقاضای پولی، نرخ ارز و قیمت های خارجی به عنوان معادلات اصلی و کمکی مورد بررسی قرار گرفته اند. این مطالعه برای اقتصاد ایران و در بازه زمانی ۸۹-۱۳۴۰ صورت گرفته و برای تجزیه و تحلیل داده ها از مدل های هم انباشتگی و رگرسیون های به ظاهر نامرتب (SUR) استفاده شده است. نتایج این مطالعه حاکی از آن است که درآمدهای نفتی در بلند مدت اثر مستقیم منفی ولی کندی بر رشد اقتصادی داشته ولی اثر منفی معناداری بر تورم دارد به این معنی که افزایش درآمدهای منفی توانسته است که تا حد زیادی از تورم بکاهد. بدین ترتیب فرضیات تحقیق مبنی بر اثرات بلند مدت درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی مورد تأیید قرار می گیرند.		

مناسب است

تاریخ و امضاء:

مناسب نیست

نظر استاد راهنما برای چاپ در پژوهش نامه دانشگاه

فهرست مطالب

صفحه

عنوان

فصل اول: کلیات طرح

۲	۱-۱ مقدمه.....
۳	۲-۱ بیان مسأله و اهمیت موضوع تحقیق.....
۵	۳-۱ هدف تحقیق.....
۵	۴-۱ سوالات و فرضیه های تحقیق.....
۵	۵-۱ مدل تحقیق.....
۶	۶-۱ روش تحقیق.....
۶	۷-۱ جامعه آماری و حجم نمونه.....
۷	۸-۱ روش گردآوری اطاعات.....
۷	۹-۱ روش تجزیه و تحلیل اطاعات.....

فصل دوم: مطالعات نظری

۹	۱-۲ مقدمه.....
۹	۲_۲ مفهوم رشد اقتصادی.....
۱۱	۳-۲ نگاهی به جریان الگوهای رشد اقتصادی.....
۱۲	۴_۲ نظریه های رشد اقتصادی.....
۱۲	۱-۴-۲ نظریه رشد کلاسیک ها.....
۱۳	۲-۴-۲ نظریه رشد ریکاردو.....
۱۳	۳-۴-۲ نظریه رشد اقتصادی مارکس.....
۱۳	۴-۴-۲ نظریه رشد کینز.....
۱۴	۵-۴-۲ نظریه رشد هارود - دومار.....
۱۵	۶-۴-۲ نظریه رشد نئوکلاسیک.....
۱۸	۵-۲ مطالعات رشد در سطح کلان.....
۱۸	۱-۵-۲ مطالعاتی که بر مبنای الگوهای رشد برونزا صورت گرفته اند.....
۱۸	۱-۱-۵-۲ الگوی رشد سولو.....
۲۱	۲-۱-۵-۲ اضافه کردن انباشت سرمایه انسانی به الگوی سولو؛ رهیافت منیکو، رومر و ویل.....
۲۳	۲-۳-۱-۵-۲ رشد برونزا و همگرایی.....
۲۵	۲-۵-۲ مطالعاتی که بر مبنای حسابداری رشد انجام گرفته اند.....
۲۶	۳-۵-۲ مطالعاتی که بر مبنای الگوهای رشد درونزا انجام شده اند.....
۳۰	۱-۳-۵-۲ مدل های رشد درونزا.....
۳۰	۱-۱-۳-۵-۲ مدل AK.....
۳۱	۲-۱-۳-۵-۲ مدل R&D.....
۳۲	۶-۲ مفهوم تورم و تعریف آن.....
۳۴	۷-۲ تورم برحسب علل بوجود آورنده.....
۳۴	۱-۷-۲ تورم ناشی از فشار تقاضا.....
۳۵	۲-۷-۲ تورم ناشی از فشار هزینه.....
۳۶	۳-۷-۲ تورم پولی.....
۳۷	۴-۷-۲ تورم ساختاری یا تورم بنیادی.....

۳۷ تورم وارداتی ۵-۷-۲
۳۷ تورم وارداتی از طریق تجارت خارجی ۱-۵-۷-۲
۳۸ تورم وارداتی ناشی از کسری یا مازاد تراز پرداخت ها ۲-۵-۷-۲
۳۸ تورم انتظاری یا نظریه روانی تورم ۶-۷-۲
۳۹ نااطمینانی تورمی ۷-۷-۲
۴۰ مهمترین مطالعات صورت گرفته در ایران ۸-۲
۴۴ پیشینه تحقیق از منابع خارجی ۹-۲

فصل سوم : روش شناسائی تحقیق

۵۰ مقدمه ۱-۳
۵۰ روش تحقیق ۲-۳
۵۰ جامعه آماری و حجم آن ۳-۳
۵۱ شوک نفتی ۴-۳
۵۱ سه شوک درآمد نفتی ۵-۳
۵۱ شوک اول نفتی ۱-۵-۳
۵۵ شوک دوم نفتی ۲-۵-۳
۵۷ شوک سوم نفتی ۳-۵-۳
۵۸ درآمدهای نفتی در آئینه ی تئوری بیماری هلندی ۶-۳
۶۲ مطالعه موردی ایران ۷-۳
۶۳ نحوه مواجهه دولت با مازاد درآمدهای نفتی سال های ۱۳۵۳، ۱۳۵۸ و ۱۳۸۴ ۸-۳
۶۵ عوامل موثر بر قیمت نفت ۹-۳
۶۶ قیمت های نفت و عدم تقارن ۱۰-۳
۶۹ قیمت نفت و رشد اقتصادی ۱۱-۳
۷۰ آثار شوک های نفتی بر سطح عمومی قیمت ها ۱۲-۳
۷۳ درآمدهای نفتی در اقتصاد ایران طی سال های ۱۳۸۸ - ۱۳۳۸ ۱۳-۳
۷۵ بررسی روند رشد اقتصادی در ایران ۱۴-۳
۸۱ نتیجه ۱۵-۳

فصل چهارم : تجزیه و تحلیل یافته های تحقیق

۸۳ مقدمه ۱-۴
۸۳ معرفی مدل ۲-۴
۸۴ برآورد تجربی مدل ۳-۴
۸۵ مدل رگرسیون های به ظاهر نامرتب (SUR) ۳-۴-۱
۸۵ آزمون ریشه واحد برای پایایی ۲-۳-۴
۸۶ همجمعی ۳-۳-۴
۸۷ مفهوم همجمعی ۴-۳-۴
۸۷ تعیین طول وقفه بهینه ۵-۳-۴
۸۷ نتایج ۴-۴
۸۷ آزمون ریشه واحد ۱_۴-۴
۸۹ نتایج تخمین مدل ۲-۴-۴
۹۴ آزمون هم انباشتگی جوهانسون ۳-۴-۴
۹۵ آزمون انگل گرنجر ۴-۴-۴
۹۷ تحلیل نتایج داده ها ۵-۴

۱۰۰..... نتیجه ۶_۴

فصل پنجم : نتیجه گیری و پیشنهادات

۱۰۳..... ۱-۵ مقدمه

۱۰۴..... ۲-۵ یافته های تحقیق

۱۰۵..... ۳-۵ نتیجه گیری

۱۰۵..... ۴-۵ پیشنهادات سیاستی

۱۰۶..... ۵-۵ پیشنهادات آتی

۱۰۷..... منابع و مأخذ

۱۱۳..... پیوست ها

فهرست جدول ها

<u>صفحه</u>	<u>عنوان</u>
۷۰	جدول ۱-۳
۸۷	جدول ۱-۴
۸۸	جدول ۲-۴
۸۹	جدول ۳-۴
۹۵	جدول ۴-۴
۹۶	جدول ۵-۴

فهرست نمودارها

<u>صفحه</u>	<u>عنوان</u>
۲۸.....	۱-۲ نمودار.....
۵۷.....	۱-۳ نمودار.....
۶۶.....	۲-۳ نمودار.....
۷۲.....	۳-۳ نمودار.....
۷۳.....	۴-۳ نمودار.....
۷۴.....	۵-۳ نمودار.....
۷۶.....	۶-۳ نمودار.....
۸۰.....	۷-۳ نمودار.....

چکیده

اثر درآمدهای نفتی بر تورم و نیز رشد اقتصادی همواره از موضوعات مهم و بحث برانگیز در میان اقتصاددانان بوده است. بسیاری از اقتصاددانان از درآمدهای نفتی به عنوان عامل موثر و مفید بر رشد اقتصادی تأیید می کنند در حالیکه دسته دیگر با این فرضیه مخالفت می کنند و آن را به عنوان عامل مخل سیستم اقتصادی میدانند ولی تقریباً همگی از کاهش فشار تورمی آن آگاه بوده و این امر را تصدیق میکنند. نتایج حاکی از مطالعات متعدد در این زمینه متفاوت از یکدیگر بوده و هیچ کدام این فرضیات را به صورت قطعی تأیید نمی کنند. هدف از این تحقیق نیز بررسی اثر درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی در ایران می باشد. در همین راستا رشد اقتصادی، تورم، تقاضای پولی، نرخ ارز و قیمت های خارجی به عنوان معادلات اصلی و کمکی مورد بررسی قرار گرفته اند. این مطالعه برای اقتصاد ایران و در بازه زمانی ۸۹-۱۳۴۰ صورت گرفته و برای تجزیه و تحلیل داده ها از مدل های هم انباشتگی و رگرسیونهای به ظاهر نامرتب (SUR) استفاده شده است.

نتایج این مطالعه حاکی از آن است که درآمدهای نفتی در بلند مدت اثر مستقیم منفی ولی کندی بر رشد اقتصادی داشته ولی اثر منفی معناداری بر تورم دارد به این معنی که افزایش درآمدهای منفی توانسته است که تا حد زیادی از تورم بکاهد. بدین ترتیب فرضیات تحقیق مبنی بر اثرات بلند مدت درآمدهای نفتی بر تورم و رشد اقتصادی مورد تأیید قرار می گیرند.

فصل اول

کلیات

طرح

۱-۱) مقدمه

تجارت خارجی از روزگاران دور مورد نظر کشورها و دولت ها بوده و به آن توجه زیادی می شده است. این توجه اغلب به این دلیل بوده که نه تنها بر روی رشد اقتصادی کشورها اثر غیر قابل انکاری داشته، بلکه برای آنها جنبه حیاتی نیز داشته و دارد.

تجارت خارجی در هر کشور از ساختار اقتصاد داخلی و همچنین چگونگی تعادل عرضه و تقاضا متأثر می باشد. داشتن یک الگوی تجارت خارجی مناسب مستلزم ساختار اقتصادی سالم و قوی است زیرا علاوه بر تعادل بخش بازرگانی اقتصاد خارجی کشور، در اقتصاد داخلی نیز موجب فراهم نمودن زمینه های رقابتی و افزایش تولید، مهار تورم و نهایتاً تأثیر گذاری بر بخش بازرگانی داخلی می باشد.^۱

تجارت خارجی شامل دو بخش است: صادرات و واردات

در بخش اول، صادرات مهمترین منبع کسب درآمد ارزی برای هر کشور است که با آن احتیاجات داخلی را برآورده می کنند. در ایران قسمت عمده و اعظم درآمدهای ارزی از صادرات نفت حاصل می شود بطوری که در بعضی از سال ها این درآمد به بیش از نود درصد کل درآمد ارزی دولت هم بالغ شده است.

ماهیت تک محصولی بودن در صادرات ایران، وابستگی شدید صنایع داخلی به دریافت های ارزی، مزاد تقاضای داخلی و مصارف تجملی ناشی از تزریقات درآمد های نفتی و همچنین وابستگی بودجه دولت و برنامه های جاری به این درآمدها، این بخش را در کشور از جایگاه ویژه ای برخوردار کرده است.^۲

۱-اخوی احمد، اقتصاد کلان، پایه ای و کاربردی، مؤسسه مطالعات و پژوهشهای بازرگانی سال ۱۳۷۴

۲-پسران هاشم، یکسان سازی نرخ ارز و نقش بازار و برنامه ریزی در بازرگانی اقتصاد ایران، سومین گزارش سیاست های پولی و ارزی -

اردیبهشت ۱۳۷۲

بخش دیگر تجارت خارجی، واردات است که حجم آن یکی از عواملی است که می تواند میزان مبادله و رابطه تجاری با خارج از کشور و همچنین مقدار نیاز وابستگی را مشخص نماید.

شاید در ابتدای امر اینگونه تصور شود که درآمدهای فراوان حاصل از منابع طبیعی برای یک کشور ایجاد ثروت کرده و پیشرفت اقتصادی و کاهش فقر را به دنبال داشته باشد و بنابراین منابع طبیعی می توانند عاملی مهم در تسریع سرمایه گذاری و به دنبال آن رشد اقتصادی باشند، اما مشاهدات تجربی عکس این ادعا را نشان می دهد. اثر مخرب وابستگی دولتها به درآمد منابع طبیعی سالهاست که مورد توجه قرار گرفته است. تجربه نشان می دهد که ثروتهای طبیعی برای شکوفائی و پیشرفت اقتصادی، نه به عنوان عامل ضروری و نه کافی می باشند. در واقع کشورهای غنی از منابع نتوانسته اند از فرصت ایجاد شده ی ناشی از درآمدهای حاصل از منابع، منافع لازم را برای اقتصاد خود کسب کنند. در همین راستا نفرین منابع اولین بار توسط اقتصاددان مشهور انگلیسی و صاحب نظر بحث نفرین منابع، ریچارد آوتی در سال ۱۹۹۳ به کار گرفته شده است. ادبیات نفرین منابع به بررسی علل ناکامی کشورهای برخوردار از این مواهب در توسعه ی اقتصادی و به خصوص شکست آنها در پایه گذاری یک رشد مستمر و مناسب اقتصادی می پردازد.

۱-۲) بیان مسأله و اهمیت موضوع تحقیق:

از سالهای متمادی، نفت به عنوان یکی از مهمترین عواملی که می تواند با تأمین ارز برای کشورهای صادرکننده نفت مفید و مثرثمر باشد، شناخته میشده است.

این ماده سیاه و قیمتی، از آنجایی که در چرخیدن چرخهای صنعت جهان، نقش مهمی بازی میکند، میتواند برای کشورهایی که از وجود انحصاری و طبیعی آن بهرمنند هستند، به عنوان یک اهرم مثبت در جهت رشد و

توسعه ی اقتصادی عمل کند. اما چرا چنین نشده است؟ به راستی چرا این معضل نفت در غالب کشورهای نفت خیز وجود دارد؟ چرا و چگونه به لحاظ نظری نفت می تواند اقتصاد را تحت تأثیر قرار دهد؟

بانک جهانی، استفاده از درآمدهای نفتی به نحوی که آسیبهای اقتصادی را به حداقل و توسعه ی اقتصادی را به حداکثر برساند، به عنوان بزرگترین چالش کشورهای در حال توسعه ی صادرکننده نفت خام برشمرده است. در کشور ما نیز، نفت به عنوان یکی از مهمترین منابع طبیعی، نقش بسزائی در دگرگونیهای اقتصادی و سیاسی در قرن حاضر داشته است. از یک سو درآمدهای نفتی یک منبع عمده درآمدی برای دولت بوده و از سوی دیگر اهمیت این ماده حیاتی برای اقتصاد کشورها، به ویژه کشورهای صنعتی موجب شده تا بر بسیاری از معادلات سیاسی در کشور ما تأثیر بگذارد. هم اکنون وابستگی به درآمدهای نفتی چنان است که در صورت نبودن این درآمدها اقتصاد کشور دچار آشفتگیهای شدیدی می شود. می توان ادعا کرد که نوسان درآمدهای نفتی مستقیماً بر چگونگی کارکرد اقتصاد کشور و رشد و رکود آن تأثیر میگذارد. یک سؤال مهم که در سالهای اخیر به کرات بین اقتصاددانها مطرح شده است، این است که چرا اقتصاد کشورهای صاحب درآمدهای نفتی با وجود حجم قابل توجه این درآمدها که در نگاه اول عامل مهمی برای تجهیز منابع سرمایه ای به شمار می آید، از رشد اقتصادی موفقی برخوردار نیستند؟ به طور دقیقتر می توان نشان داد که از بین بیش از ده کشور بزرگ تولیدکننده نفت، تنها نروژ که دارای ساختار سیاسی و تاریخی کاملاً متفاوتی با بقیه کشورها است و البته توانسته است به شیوهای متفاوت و معقول درآمدهای نفتی را مدیریت کند، رشد اقتصادی مناسبی را تجربه کرده و بقیه ی کشورها عموماً با مسائل مشکل و مهمی در این رابطه مواجه بوده اند. این پرسش که چرا برای اکثر این کشورها، آن ثروت بی سابقه و سهل الوصول نه به بهروزی و سعادت بلکه به شوربختی و فلاکت انجامید، پرسش بسیار مهمی است.

۳-۱) هدف تحقیق :

هدف این تحقیق بررسی رابطه کوتاه مدت و بلند مدت بین درآمدهای ارزی (درآمدهای نفتی) بر تورم و رشد اقتصادی کشور ایران می باشد.

۴-۱) سوالات یا فرضیه های تحقیق (بیان روابط بین متغیرهای مورد مطالعه):

۱- آیا بین درآمدهای نفتی و تورم رابطه معناداری وجود دارد؟

۲- آیا بین تورم و رشد اقتصادی رابطه معناداری هست؟

۳- آیا درآمدهای نفتی رابطه معناداری با رشد اقتصادی دارد؟

فرضیه اول: بین درآمدهای نفتی و تورم رابطه معنادار و مستقیمی وجود دارد.

فرضیه دوم: درآمدهای ارزی نفتی رابطه معناداری با رشد اقتصادی دارد.

۵-۱) مدل تحقیق:

هدف اصلی ما معادلات ۲ و ۱ هستند ولی ما باید تأثیر درآمدهای نفتی بر روی متغیرهای معادلات ۲ و ۱ را در نظر بگیریم پس معادلات ۳ و ۴ و ۵ را نیز وارد میکنیم.

$$۱) RNOY = F (RE_t, OIL_t, RNOY_{t-1}, RNOY^*, DR)$$

$$۲) P_t = F(P_t^f, E_t, M_t^s, M_t^d, P_{t-1}^d, P_{t-1}^{d*}, OIL_{t-1}, P_{t-1}^d, DR_t)$$

$$۳) E_t = F (E_{t-1}, P_t^d, P_t^f, DR_t, OIL_{t-1}, P_t^d)$$

$$۴) M_t = F (M_{t-1}, P_t^d, Y_t, OIL_t, DR_t)$$

$$۵) P_t^f = (P_{t-1}^f, OIL_t)$$

(rnoy) : رشد اقتصادی حقیقی بدون نفت

(re) : نرخ ارز رسمی

(oil): درآمدهای ارزی نفتی

(p^d): قیمت های داخلی، شاخص قیمتی مصرف کننده

(p^f): قیمت های خارجی، شاخص قیمتی GDP در امریکا و به دلار

(m^s): عرضه پول

(m^d): تقاضای پول

(DR): متغیردایمی که بعد از انقلاب با مقدار یک، قبل از انقلاب با مقدار صفر

(oilp): قیمت نفت به دلار

(y): رشد اقتصادی با درآمدهای نفتی

(m): عرضه پول به صورت نقدینگی

اندیس (t): دوره جاری، اندیس (t-1) یک دوره قبل

متغیرهای دارای علامت (*) مقادیر بلند مدت میباشد.

قیمت های نفتی با واحد میلیون دلار، و سایر موارد میلیارد ریال می باشد.

۱-۶) روش تحقیق:

این تحقیق از نظر هدف یک تحقیق کاربردی است و از نظر ماهیت و روش تحقیق توصیفی، تحلیلی و همبستگی است.

۱-۷) جامعه آماری و حجم نمونه:

جامعه مورد نظر در این تحقیق کشور ایران بوده و کلیه تخمین ها و برآوردها مربوط به همین کشور و با استفاده از دادهای سری زمانی و به صورت سالانه طی سالهای ۱۳۴۰_۸۹ می باشد.