

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

به نام خدا

منشور اخلاق پژوهش

با یاری از خداوند سبحان و اعتقاد به اینکه عالم محضر خداوند است و همواره ناظر بر اعمال انسان و به منظور پاس داشتن مقام بلند دانش پژوهش و نظر به اهمیت جایگاه و دانشگاه در اعتلای فرهنگ و تمدن بشری ما دانشجویان و اعضای هیات علمی واحدهای دانشگاه آزاد اسلامی متعهد می گردیم.

اصول زیر را در انجام فعالیت های پژوهشی مد نظر قرار داده و از آن تخطی نکنیم:

- ۱- اصل برائت: التزام به برائت جویی از هرگونه رفتار غیر حرفه ای و اعلام موضوع نسبت به کسانی که حوزه علم و پژوهش را به شائب های غیر علمی می پالایند.
- ۲- اصل رعایت انصاف و امانت: تعهد به اجتناب از هرگونه 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 آنبه 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 هرگونه حرمت شکنی.
- ۵- اصل رعایت حقوق: التزام به رعایت کامل حقوق پژوهشگران و پژوهیدگان (انسان حیوان و نبات) و سایر صاحبان حق.
- ۶- اصل راز داری: 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 هرگونه 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: اقتصاد انرژی

عنوان:

بررسی اثر نا اطمینانی قیمت نفت بر روی متغیرهای کلان اقتصادی (با تاکید بر تورم و بیکاری)

استاد راهنما:

دکتر محمد علی خطیب سمنانی

استاد مشاور:

دکتر رویا سیفی

دانشجو:

سید مرتضی واعظی

پائیز ۹۲

تقدیم به:

به سایه بانان آرامش

به زیباترین آفرینش های خالق

به پدر و مادرم که یاریم کردند تا بیاموزم

تشکر و قدر دانی :

از استاد ارجمند، جناب آقای دکتر محمد علی خطیب سمنانی که زحمت راهنمایی این پایان نامه را بر عهده داشتند ، که در نهایت لطف و بزرگواری ، تمامی سعی و تلاش خود را در انجام موفق این پایان نامه مبذول فرمودند و همچنین خانم دکتر رویا سیفی پور کمال تشکر و قدردانی را دارم.

تعهد نامه اصالت پایان نامه کارشناسی ارشد

اینجانب سید مرتضی واعظی دانش آموخته مقطع کارشناسی ارشد ناپیوسته به شماره دانشجویی ۸۹۰۹۳۷۰۰۰۰۰ در رشته اقتصاد انرژی که در تاریخ ۱۲/۸/۹۲ از پایان نامه خود تحت عنوان :

اثر نااطمینانی درآمدهای نفتی برای متغیرهای کلان با تاکید بر تورم و بیکاری با کسب نمره ۱۷/۵ و درجه بسیار خوب دفاع نموده ام بدینوسیله متعهد می شوم:

۱- این پایان نامه حاصل تحقیق و پژوهش انجام شده توسط اینجانب 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 اینجانب مطابق ضوابط و مقررات رفتار نموده و در صورت ابطال مدرک تحصیلی ام هیچگونه ادعایی نخواهم داشت.

نام و نام خانوادگی :

تاریخ و امضاء

بسمه تعالی

در تاریخ: ۹۲/۸/۱۲

دانشجوی کارشناسی ارشد آقای سید مرتضی واعظی از پایان نامه خود دفاع نموده و با نمره ۱۷/۵ بحروف هفده و پنجاه صدم و با درجه بسیار خوب مورد تصویب قرار گرفت .

امضاء استاد راهنما :

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول- کلیات پژوهش
۲	۱-۱ بیان مسئله
۷	فصل دوم- ادبیات موضوع
۸	مقدمه
۹	۱-۲ پیشینه تحقیق
۹	۱-۱-۲ مطالعات داخلی
۱۰	۲-۱-۲ مطالعات خارجی
۱۲	۲-۲-۲ تاثیر نفت بر متغیرهای اقتصاد کلان
۱۷	۱-۲-۲ تاثیر شوک های نفتی بر تورم
۱۷	۳-۲-۳ نااطمینانی درآمدهای نفتی
۲۱	۴-۲-۴ تورم و پیامدهای آن
۲۱	۱-۴-۲ مروری بر نظریه های تورم
۲۱	۲-۴-۲ مکتب اصالت پول
۲۲	۳-۴-۲ مکتب کینز و تورم
۲۲	۴-۴-۲ نظریه فشار هزینه
۲۲	۵-۴-۲ نظریه ساختار گرایان
۲۳	۶-۴-۲ تورم روانی
۲۳	۷-۴-۲ تورم وادراتی
۲۴	۵-۲-۵ بیکاری
۲۵	۱-۵-۲ منحنی فیلیپس
۲۷	۶-۲ مطالعات انجام شده

۲۷	۱-۶-۲ مطالعات انجام شده خارجی
۲۹	۲-۶-۲ مطالعات انجام شده داخلی
۳۳	۷-۲ جمع بندی
۳۵	فصل سوم- روند متغیرها
۳۶	۱-۳ مقدمه
۳۸	۲-۳ بیکاری
۴۰	۳-۳ نفت
۴۳	۱-۳-۳ نفت ایران
۴۵	۲-۳-۳ تحولات جهانی قیمت نفت خام
۵۰	۳-۳-۳ صادرات نفت خام
۵۲	۴-۳-۳ تولید نفت خام
۵۳	۵-۳ تولید ناخالص داخلی به قیمت ثابت سال ۲۰۰۵
۵۴	۶-۳ باز بودن اقتصاد
۵۵	۷-۳ متدولوژی تحقیق
۵۷	۸-۳ جمع بندی
۵۹	فصل چهارم- برآورد مدل
۶۰	۱-۴ مقدمه
۶۰	۲-۴ روش شناسی تحقیق
۶۱	۱-۲-۴ مدل ARCH
۶۲	۲-۲-۴ مدل GARCH (حالت متقارن)
۶۲	۳-۲-۴ مدل ARCH-M
۶۳	۴-۲-۴ مدل های مبتنی بر عدم تقارن TARCH و EGARCH
۶۴	۵-۲-۴ آزمون AECH

۶۵	ARCH مدل برآورد مدل
۶۷	ARCH اثرات آزمون اثرات ARCH
۶۷	آزمون ریشه واحد
۷۱	GMM تخمین زنده های GMM
۷۱	روش گشتاورها
۷۲	شرایط گشتاوری
۷۲	روش تخمین گشتاورها
۷۳	تخمین روش تعمیم یافته گشتاورها
۷۴	GMM تخمین زنده GMM
۷۴	بررسی تاثیر نوسانات درآمد نفت بر نرخ بیکاری
۷۸	بررسی تاثیر نوسانات درآمد نفت بر تورم
۸۲	جمع بندی
۸۴	فصل پنجم-نتایج و پیشنهادات
۸۵	مقدمه
۸۶	۱-۵ نتایج
۸۹	۲-۵ پیشنهادات
۹۰	منابع

فهرست جداول

- جدول (۱-۳): نرخ بیکاری در جمعیت ۱۰ ساله و بیشتر به تفکیک فصول ۳۹
- جدول (۲-۳): تغییر در تولید کل جهان در سال های وقوع تکانه های نفتی ۴۳
- جدول (۱-۴): برآورد مدل ARCH طی دوره ی زمانی ۱۳۸۰-۱۳۹۰ ۶۶
- جدول شماره (۲-۴): آزمون دیکی- فولر تعمیم یافته ۶۸
- جدول (۳-۴): نتایج آزمون همگرایی یوهانسن ۷۱
- جدول (۴-۴) - برآورد مدل (۲) به روش گشتاورهای تعمیم یافته طی سال های ۱۳۸۰-۹۰ ۷۶

فهرست نمودار

- نمودار (۱-۳) : روند نرخ تورم ایران به صورت فصلی ۳۷
- نمودار (۲-۳) : نرخ بیکاری در جمعیت ۱۰ ساله و بیشتر (۱۳۷۶-۱۳۹۰) ۴۰
- نمودار (۳-۳) : روند قیمت نفت خام ایران به صورت فصلی ۴۵
- نمودار (۴-۳) : مجموع صادرات نفت خام (هزار بشکه در روز) به صورت فصلی ۵۲
- نمودار (۵-۳) : روند تولید نفت خام ایران به صورت فصلی ۵۳
- نمودار (۶-۳) : روند تولید ناخالص داخلی ایران به صورت فصلی ۵۴
- نمودار (۷-۳) : روند درجه بازبودن اقتصاد (به صورت درصدی از GDP) ایران ۵۵

فصل اول

کلیات پژوهش

۱-۱ بیان مسئله

در ابتدا به تعریف نا اطمینانی میپردازیم: نا اطمینانی شرایطی است که در آن یا پیشامدهایی ممکن در آینده اتفاق می افتد مشخص و معلوم نیست یا این که اگر این پیشامدها مشخص و معلوم باشد احتمال های مربوط به وقوع این پیشامدها در دسترس نیست و وقتی که هر کدام یا هر دو این موارد پیش آید تصمیم گیری نسبت به آینده پیچیده و مشکل است و از این رو فضای نا اطمینانی به تصمیم ها حاکم می شود.

نوسانات قیمت نفت اصلی ترین منبع نوسانات اقتصادی کشورهای تولیدکننده نفت می باشند. افزایش ناگهانی قیمت نفت بعد از سال ۱۹۷۳ تأثیرات مهمی بر روی اقتصاد کشورهای صادرکننده نفت گذاشت به طوری که می توان اظهار داشت در این دوره درآمدهای ارزی حاصل از فروش نفت به شدت افزایش یافت و باعث رشد سطح قیمت ها، نرخ های دستمزد و واردات در کشورهای صادر کننده نفت خام گردید. رشد بخش نفت به عنوان یک عامل مؤثر در درآمد ملی، منجر به افزایش تقاضای کل اقتصاد و در نتیجه افزایش قیمت ها و سودآوری در بخش غیرقابل مبادله نسبت به بخش قابل مبادله می گردد، در نتیجه این امر باعث سرازیر شدن سرمایه و نیروی کار به سمت بخش غیرقابل مبادله و قوی تر شدن این بخش در مقابل ضعیف تر شدن بخش قابل مبادله اغلب اقتصادهای تک محصولی می شود. این پدیده در ادبیات اقتصادی به «بیماری هلندی» معروف است. نتیجه بیماری هلندی در کشورهای صادرکننده نفت، افزایش قابل توجه سهم بخش نفت در درآمد ملی نسبت به بخش های غیرنفتی می باشد. در این شرایط افزایش درآمدهای سرانه، تنها به دلیل افزایش درآمدهای نفتی می باشد و این پدیده حتی در اقتصادهای متنوع و نسبتاً بزرگ مانند ایران نیز قابل مشاهده است. بنابراین جهت جلوگیری از بروز بحران های اقتصادی و طراحی سیاست های مناسب به منظور حفظ تعادل و ثبات اقتصادی، بررسی اثرات تغییر در قیمت های جهانی نفت بر روی متغیرهای کلان اقتصادی بسیار ضروری می باشد. همچنین تدوین برنامه های توسعه اقتصادی - اجتماعی و تنظیم بودجه های سالانه کشور مستلزم شناخت و انجام پیش بینی های دقیق از میزان تأثیرگذاری نوسانات

قیمت نفت بر متغیرهای کلان اقتصادی می‌باشد، به طوری که برنامه‌ریزان بتوانند به هنگام بروز تکانه های نفتی، تأثیر آن را بر متغیرهای کلان به حداقل ممکن کاهش دهند و سیاست‌های صحیحی را اتخاذ کنند.

کشورهای در حال توسعه از جمله ایران از درجه بالایی از ناطمینانی متغیرهای کلان اقتصادی برخوردار هستند. رشد، تورم، نرخ ارز و سایر متغیرهای مهم کلان نسبت به اقتصاد کشورهای صنعتی بیشتر در معرض نوسان هستند و اثرات این نوسانات بالا از چندین دیدگاه - رشد و سرمایه گذاری - تجارت در مطالعات تجربی مورد توجه قرار گرفته است.

تأثیر افزایش درآمدهای نفتی بر کشورهای صادرکننده نفت از مباحث بحث‌انگیز اقتصاد سیاسی است. به طور کلی و به خصوص در مورد ایران می‌توان این تأثیر را به نحوه‌ی هزینه کردن دولت، ساختار اقتصادی و رفتار دولت در داخل کشور مشاهده کرد.

معمولاً در کشورهای صادرکننده نفت درآمدهای صادرات نفت، به عنوان درآمد بخش دولتی محسوب و از طریق خزانه وارد بودجه می‌شود. این مسأله سبب می‌گردد که درآمدهای نفتی از طریق ردیف‌هزینه‌های دولت به دو صورت جاری و عمرانی به اقتصاد کشور تزریق شود.

امروز تأثیر بسیار منفی افزایش هزینه‌های جاری دولت بر ساختار اقتصادی، به خصوص تأثیرات منفی آن بر سرمایه‌گذاری بخش خصوصی که نشان‌دهنده‌ی مشارکت مردم در اداره‌ی اقتصاد است، بر همگان آشکار است و مطالعات انجام شده در این زمینه همگی در این موضوع اتفاق نظر دارند. کشورهای صادرکننده نفت به دلیل ساختار و مسایل سیاسی آنها، دولت به عنوان بزرگ‌ترین کارگزار اقتصادی کشور در اغلب بخش‌های تولیدی و خدماتی حضور فعال دارد. انتظارات سیاسی و اجتماعی از دولت که عموماً فاقد مبنای اقتصادی است، سبب می‌شود که اغلب تأثیرات هزینه‌های سرمایه‌ای دولت نیز به سان هزینه‌های جاری باشد. سرمایه‌گذاری عمده دولتی از برنامه زمان‌بندی مدون خود تبعیت نمی‌کند، حجم سرمایه‌گذاری از رقم پیش‌بینی شده (و بر اساس آن توجیه اقتصادی صورت گرفته) فراتر می‌رود و مدیریت دولتی غیرکارآمد نیز سبب می‌شود که اثرات توسعه‌ای این قبیل سرمایه‌گذاری‌ها ضعیف باشد.

علاوه بر هزینه‌های جاری، هزینه‌های سرمایه‌ای دولت در بخش ساختمان نیز مانعی برای حضور سرمایه‌گذاری بخش خصوصی است. تأثیرات منفی هزینه‌های دولت فقط به سال مورد بررسی نیز بسنده نمی‌کند و این هزینه‌ها و افزایش سالانه آنها همیشه وبال گردن دولت می‌شود.

از آنجا که درآمدهای نفتی حاصل عملکرد فعالیت بخش‌های اقتصادی نبوده، بنابراین افزایش آنها نشان دهنده رونق واقعی اقتصاد نیست، بنابراین افزایش این درآمدها و تزریق آنها به جامعه به سرعت به افزایش قیمت‌ها منجر می‌شود. برای روشن شدن این مسأله مثالی از دو کشور می‌آوریم که یکی صنعتی است و دیگری صادرکننده نفت.

فرض کنید که در کشور اول سالیانه ۲۰۰ میلیارد دلار صادرات صنعتی صورت می‌گیرد. در حقیقت بخش‌های مختلفی از اقتصاد این کشور دست به دست همدیگر می‌دهند که کالای مورد نظر را که مجموعه‌ای از قطعات و کالاهای واسطه‌ای دیگر هستند تولید و با صادرات آن ۲۰۰ میلیارد دلار درآمد ایجاد کنند. اما فرض کنید که ۱۸۰ میلیارد دلار برای صادرات ۲۰۰ میلیارد دلاری هزینه شده است. این هزینه که در حقیقت پرداختی به عامل تولید نظیر نیروی کار، سرمایه و مدیریت است سبب رونق بخش‌های دیگر می‌شود و در واقع چرخه اقتصاد کشور را به حرکت درمی‌آورد. از سوی دیگر درآمد خالص ایجاد شده نیز ۲۰ میلیارد دلار است.

در کشور دوم وضع به گونه‌ای دیگر است. در حالی که ممکن است بخش‌های مختلف اقتصادی دچار کاستی‌های عظیمی چون فناوری قدیمی، نیروی کار با کارآمدی پایین، قوانین مالکیت، کار و مالیاتی نامناسب باشد، به دلیل یک عامل خارجی که هیچ گونه ارتباطی با بخش‌های داخلی ندارد، قیمت نفت افزایش یابد و یک باره درآمدهای نفتی و صادراتی که در واقع به عنوان درآمدهای دولتی تلقی می‌شود افزایش زیادی یابد، مثلاً عایدات این کشور از صدور نفت به ۲۲ میلیارد دلار برسد. برای درآمد ایجاد شده کدام یک از بخش‌های داخلی درگیر فعالیت و تلاش هستند، چه میزان یا درصدی از نیروی کار داخلی را به فعالیت واداشته است؟ هزینه ایجاد شده برای چنین درآمدی چقدر است؟

اگر هزینه مورد نظر ۲ میلیارد باشد، رقم درآمد خالص آن نیز همانند کشور اول (کشور صنعتی) ۲۰

میلیارد دلار می‌شود. به عبارت دیگر در حالتی که رقم درآمد خالص صادراتی دو کشور به یک میزان هستند ولی این دو کشور از دو وضعیت متفاوت در ساختار داخلی اقتصاد برخوردارند.

بنابراین تزریق درآمدهای یاد شده در کشورهای از نوع دوم، نظیر ایران سبب افزایش تقاضای کل می‌گردد، از آن جایی که بخش عرضه کل که برآیند بخش‌های داخلی است نمی‌تواند به تقاضای ایجاد شده پاسخ گوید، بنابراین منجر به افزایش تورم می‌شود و تورم نیز به نوبه‌ی خود علاوه بر متغیرهای اقتصادی بر متغیرهای سیاسی و اجتماعی اثر می‌گذارد. این مسأله با کاهش قیمت نفت و در نتیجه کاهش درآمدهای دولت شکل انفجاری به خود می‌گیرد. تجربه‌ی کشورهای صادرکننده نفت از جمله ایران در برنامه پنجم توسعه قبل از انقلاب، تجربه‌ای بسیار گران‌بها در این خصوص است.

کاهش قیمت نفت سبب می‌شود که دولت، به علت انعطاف‌پذیری هزینه‌های جاری، که بخش عمده آن را به هزینه‌های جاری منتقل کند. بنابراین اولین اثر آن ظهور انبوهی از طرح‌های نیمه‌تمام در بخش عمرانی است.

این مسأله سبب رکود و بیکاری به خصوص در بخش‌هایی می‌شود که عمدتاً از کارگران غیرماهر استفاده می‌کنند و بدین ترتیب بی‌ثباتی از حوزه اقتصاد به حوزه‌های اجتماعی و سیاسی نیز سرایت می‌کند. بخش ارزی (حلافی و همکاران، ۱۳۸۳)، تراز پرداخت‌ها و کسری بودجه را تحت تأثیر قرار می‌دهد و تورم که از همان ابتدا وجود داشته است سبب کاهش رشد اقتصادی می‌شود.

افزایش درآمدهای صادراتی بالا رفتن نرخ رشد اقتصادی را به همراه دارد، اما تأثیر این افزایش کاهش یافته و آنی نیست.

افزایش ناگهانی قیمت نفت در کوتاه مدت سبب افزایش درآمدهای دولت می‌شود.

در این شرایط ما با دولتی روبه‌رو هستیم که محدودیت‌های بودجه برای آن وجود ندارد و می‌تواند در فرآیند توسعه اقتصادی شتاب به خرج دهد، پروژه‌های جدید تعریف و اعمال حاکمیت کند. این مسأله سبب می‌شود که فرآیند توسعه یک «برنامه دولتی» تلقی گردد. شهروندان احساس می‌کنند که با افزایش قیمت نفت با دولت مقتدری روبه‌رو هستند که به خاطر پر شدن خزانه‌اش هر چه زودتر باید عقب‌افتادگی کشور را از بین ببرد و یک شبه رفاه اجتماعی را افزایش دهد. طبیعی است که این مسأله

در کوتاه مدت جواب مثبت دهد. پروژه‌های اقتصادی تعریف می‌شوند، دوره عملیاتی کردن و ساخت آنها گروه‌های شغلی متعددی را درگیر فعالیت می‌کند، اما دوره بهره‌برداری از آن دیگر نمی‌تواند به سرعت افراد زیادی را - که بخش عمده‌شان غیرمالی هستند - به کار مشغول کند. در چنین فضایی هر گونه موفقیت و کامیابی به کام دولت نوشته شده و دولتمردان القاب و مدال‌های متعددی دریافت می‌کنند و در مقابل بدیهی است که هر مشکلی نیز باید از سوی دولت حل شود، که در غیر این صورت دولت آلوده، بی‌لیاقت و لایق سقوط است. در این فضای اجتماعی - اقتصادی مردم خانه‌نشین و نظاره گر دولت هستند.

ماهیت درآمدهای نفتی به گونه‌ای است که بخش‌های بومی در اقتصاد رابطه پیشین و پسین ضعیفی با درآمدهای نفتی دارند و در نتیجه درآمدهای نفتی به صورت درآمدی مستقل و کاملاً غیرعادی و بی سابقه برای دولت تلقی می‌شود. در این شرایط هزینه‌های دولت از سوی مالیات‌دهندگان تأمین نمی‌شود. به عبارت دیگر مردم سهمی ناچیز در هزینه‌های توسعه دارند و در مقابل دولت به دلیل دستیابی به درآمدهای مستقل از ملت به برنامه‌های توسعه خود خوانده می‌پردازند. جالب آنجاست که دولت در اجرای برخی از برنامه‌های توسعه با مقاومت مردم نیز روبه‌رو است.

مسئله بسیار واضح است چون این هزینه‌ها از سوی مردم تأمین نمی‌شوند دولت نیز نیازی به تأمین نظر مردم ندارد و شکاف دولت - ملت که به علت استبداد از دیرباز در ایران وجود داشته است تشدید می‌شود و شالوده این شکاف با اقتصاد قوت می‌گیرد.

فصل دوم

ادبیات موضوع

مقدمه

نفت یکی از منابع مهم درآمدی برای کشورهای صادرکننده نفت و همچنین ماده خام اصلی در فرایند تولید در کشورهای واردکننده نفت می‌باشد. نوسان های قیمت نفت می‌تواند موجب بی‌ثباتی در متغیرهای کلان در هر دو گروه از کشورهای صادرکننده و واردکننده نفت شود. نوسان های قیمت نفت می‌تواند به دلیل وابستگی زیاد آن به درآمدهای نفتی، آثار ویژه ای بر اقتصاد ایران داشته باشد. بازار نفت به دلیل عدم امید به کشف منابع جدید، کمبود سرمایه گذاری در تولید نفت و گاز به ویژه در اوپک، رشد تقاضای نفت کشورهای در حال توسعه و اقتصادهای نوظهور و بحران های سیاسی و نظامی در سطح جهان مورد تاکید است. با توجه به نوسان های نفت و بی ثباتی در بازار نفت جهانی، مطالعه شوک های قیمتی نفت مورد توجه اقتصاددانان کلان قرار گرفته است. به دلیل متکی بودن بودجه دولتی ایران به درآمدهای نفتی، تغییرات در قیمت نفت تاثیر قابل ملاحظه ای بر اقتصاد ایران دارد. منبع اصلی کمک های مالی و یارانه ها، درآمدهای نفتی است. پس درآمد حاصل از صدور نفت خام به طور غیر مستقیم بر دیگر فعالیت های اقتصادی نیز تاثیر گذار است (صمدی و همکاران، ۱۳۸۸).

در این فصل به تعاریفی پیرامون متغیرهای اقتصادی کلان نظیر تورم، بیکاری و همچنین توضیحاتی در رابطه با درآمدهای نفتی و مسائل مرتبط با آن پرداخته شده و مبانی نظری موجود در این زمینه ارائه گردیده است و در آخر مطالعات انجام شده داخلی و خارجی در این زمینه عنوان شده است.