

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی

گروه اقتصاد

پایان نامه کارشناسی ارشد

عنوان:

بررسی عدم تقارن در ادوار تجاری ایران و نقش تکانه‌های نفتی در ایجاد آن

تحقیق و نگارش:

فرزانه پیرو

استاد راهنما:

دکتر سید عزیز آرمن

استاد مشاور:

دکتر منصور زراء نژاد

شهریور ماه ۱۳۸۹

تقدیم:

انگیزه این اثر، پیوستن قطره‌ای است به اقیانوس علوم ایران زمین.
انظار اتنانی است به پیشگاه پدرم که الفبای انسانیت را به من آموخت.
تقدیمی است به مهربان مادرم که نگاهش مضمون بود و دعایش راهگشای بدفتم.

تقدیر و تشکر

حمد و سپاس فراوان بر خداوند تبارک و تعالی که توفیق انجام این اثر ناچیز را به اینجانب ارزانی داشت. به این وسیله لازم می دانم از کلیه اساتید، همکاران و دوستانی که بارها به منی خود در حین مراحل انجام این تحقیق کمک شایانی نمودند تقدیر و تشکر نمایم.

به ویژه از:

- استاد راهنمای عزیز و دلسوزم جناب آقای دکتر سید عزیز آرمین که در تمام مراحل انجام این تحقیق صمیمانه در کنار من بودند و تجارب و اطلاعات خویش را در اختیار من قرار دادند.

- استاد مشاورم جناب آقای دکتر زراء نژاد که در طول انجام این تحقیق از هیچ گلی دریغ نکردند و از مشاوره ها و راهنمایی های ایشان همیشه بهره مند بودم.

- سایر اساتید و پرسنل گروه اقتصاد که اینجانب را در انجام مراحل مختلف پایان نامه یاری دادند.

- و سرانجام از دوستان عزیزم که از هیچ گلی دریغ نکردند و همواره در کنار من بودند.

فرزانه پیرو

شهریور ۱۳۸۹

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
	کلیات
۲	مقدمه
۴	ضرورت تحقیق
۵	اهداف تحقیق
۵	سوالات تحقیق
۵	فرضیات اصلی تحقیق
۷	روش تجزیه و تحلیل داده‌ها و آزمون فرضیه‌ها
	فصل اول: بررسی روند تولید ناخالص داخلی و درآمد حاصل از صادرات نفت ایران
۹	مقدمه.....
۹	۱-۱- بررسی روند تحولات تولید ناخالص داخلی و رشد اقتصادی کشور.....
۱۱	۱-۱-۱- بررسی دور تجاری ۱۳۵۳-۱۳۵۹.....
۱۲	۱-۱-۲- بررسی دور تجاری ۱۳۵۹-۱۳۶۷.....
۱۴	۱-۱-۳- بررسی دور تجاری ۱۳۶۷-۱۳۷۴.....
۱۶	۱-۱-۴- بررسی دور تجاری ۱۳۷۴-۱۳۸۰.....
۱۷	۱-۱-۵- بررسی دور تجاری ۱۳۸۰-۱۳۸۶.....
۲۰	۲-۱- بررسی روند درآمد های حاصل از صادرات نفت طی دوره ۱۳۳۳-۱۳۸۵.....
۲۰	۱-۲-۱- بررسی روند درآمد های حاصل از صادرات نفت طی دوره ۱۳۳۳-۱۳۵۷.....
۲۰	۲-۲-۱- بررسی روند درآمد های حاصل از صادرات نفت طی دوره ۱۳۵۸-۱۳۸۵.....
۲۲	۳-۱- چگونگی تاثیر تکانه های انرژی بر اقتصاد.....
۲۴	۱-۳-۱- آثار افزایش بهای نفت بر اقتصاد.....
۲۷	۲-۳-۱- آثار کاهش بهای نفت بر اقتصاد.....
۲۷	۴-۱- نفت و نقش آن در کشورهای در حال توسعه.....
۲۸	۵-۱- نتیجه گیری.....

فصل دوم: مبانی نظری

۳۳مقدمه
۳۶۱-۲- مفهوم ادوار تجاری
۳۸۱-۱-۲- چه نیروهایی باعث بروز رکود می شوند؟
۴۱۲-۱-۲- سیاست های کلان و ادوار تجاری (سیاست های کنترلی ادوار تجاری)
۴۲۲-۲- حقایق آشکار شده ادوار تجاری
۴۴۳-۲- طبقه بندی متغیر های اقتصادی براساس الگو های ادوار تجاری
۴۴۱-۳-۲- متغیر های واقعی
۴۴۱-۱-۳-۲- مصرف، سرمایه گذاری، موجودی انبار، بودجه دولت، صادرات و واردات
۴۷۲-۱-۳-۲- اشتغال بخشی، اشتغال کل، بهره وری و بهره برداری از ظرفیت
۴۸۲-۳-۲- متغیر های پولی
۴۹۳-۳-۲- متغیر های قیمتی
۴۹۴-۲- دیدگاه مکتب های مختلف پیرامون ادوار تجاری
۵۰۱-۴-۲- نظریه های طرف تقاضای ادوار تجاری
۵۰۱-۱-۴-۲- دیدگاه مکتب کینزی
۵۲۲-۱-۴-۲- الگوی هیکس
۵۴۳-۱-۴-۲- دیدگاه مکتب شیکاگو (پولی) در زمینه ادوار تجاری
۵۷۴-۱-۴-۲- مکتب انتظارات عقلایی
۵۸۲-۴-۲- نظریه های طرف عرضه ادوار تجاری
۵۸۱-۲-۴-۲- دیدگاه مکتب کلاسیک های جدید در زمینه ادوار تجاری
۶۱۲-۲-۴-۲- نظریه های شرایط جوی در ارتباط با سیکل تجاری
۶۲۳-۲-۴-۲- نظریه ادوار تجاری واقعی
۶۸۵-۲- روش های جداسازی چرخه های تجاری
۸۲۶-۲- ویژگی های ادوار تجاری
۸۴۷-۲- تقارن و عدم تقارن در چرخه های اقتصادی
۸۶۸-۲- تکانه و روش های اندازه گیری
۸۶۱-۸-۲- تعریف تکانه
۸۶۲-۸-۲- انواع تکانه

۸۸ ۲-۸-۳- اثرات نامتقارن قیمت نفت بر رشد اقتصاد.....
۹۱ ۲-۹- نتیجه گیری.....

فصل سوم: مبانی تجربی ادوار تجاری

۹۶ مقدمه.....
۹۶ ۳-۱- سابقه تحقیقات و مطالعات انجام گرفته در خارج از ایران.....
۱۰۹ ۳-۲- سابقه تحقیقات و مطالعات انجام گرفته در ایران.....
۱۲۳ ۳-۳- نتیجه گیری.....

فصل چهارم: روش تحقیق

۱۲۸ مقدمه.....
۱۲۸ ۴-۱- سری‌های زمانی پایا.....
۱۳۰ ۴-۲- آزمون ریشه واحد.....
۱۳۱ ۴-۳- آزمون دیکی- فولر و دیکی- فولر تعمیم یافته.....
۱۳۴ ۴-۴- روش‌های تجزیه شوک نفتی.....
۱۳۶ ۴-۵- مدل‌های متغیر وابسته گسسته.....
۱۳۹ ۴-۶- مدل GARCH.....
۱۴۲ ۴-۶-۱- ویژگی‌های فرآیندهای (۱۱) GARCH.....
۱۴۵ ۴-۷- آزمون فرضیه تقارن چرخه های اقتصادی.....
۱۴۶ ۴-۷-۱- عدم تقارن در شیب چرخه های اقتصادی.....
۱۴۶ ۴-۷-۱-۱- الگوی دیلانگ و سامرز.....
۱۴۸ ۴-۷-۱-۲- الگوی نفتچی.....
۱۵۳ ۴-۷-۱-۳- الگوی گالگاتی.....
۱۵۵ ۴-۷-۲- عدم تقارن در عمق در چرخه های اقتصادی.....
۱۵۵ ۴-۸- نتیجه گیری.....

فصل پنجم: معرفی متغیرها و برآورد مدل

۱۵۹ مقدمه.....
۱۵۹ ۵-۱- نظری بر ادوار تجاری در اقتصاد ایران در سال‌های ۱۳۳۱ الی ۱۳۸۶.....

۱۶۶۲-۵-آزمون فرضیه تقارن در چرخه‌های اقتصادی.....
۱۷۱۳-۵-معرفی مدل ادوار تجاری.....
۱۷۳۱-۳-۵-داده‌ها و اطلاعات آماری.....
۱۷۳۲-۳-۵-آزمون پایایی متغیرهای مدل.....
۱۷۵۳-۳-۵-تصریح مدل‌های اقتصاد سنجی برای آزمون فرضیه دوم.....
۱۷۵۱-۳-۳-۵-تصریح اول: برآورد الگو به صورت متقارن یا خطی.....
۱۷۷۲-۳-۳-۵-تصریح دوم: برآورد الگو با استفاده از معیار مورک.....
۱۸۰۳-۳-۳-۵-تصریح سوم: برآورد الگو با استفاده از معیار هامیلتون.....
۱۸۱۴-۳-۳-۵-تصریح چهارم: برآورد الگو با استفاده از تصریح مقیاس.....
۱۸۳۴-۳-۵-آزمون فرضیه سوم به روش لوجیت.....
۱۸۴۴-۵-نتیجه‌گیری.....

فصل ششم: نتیجه‌گیری و پیشنهادات

۱۸۹۱-۶-جمع‌بندی و نتیجه‌گیری.....
۱۹۶۲-۶-ارائه پیشنهادات.....

منابع

۱۹۹منابع فارسی.....
۲۰۳منابع لاتین.....

پیوست

۲۱۳پیوست ۱.....
۲۱۹پیوست ۲.....
۲۳۳چکیده.....

فهرست جداول

صفحه	عنوان
۱۰	جدول (۱-۱): بررسی رشد تولید ناخالص داخلی با استفاده از میانگین نرخ رشد و انحراف معیار.....
۱۳	جدول (۲-۱) رشد نقدینگی، تورم و رشد اقتصادی در دوره ۱۳۸۵-۱۳۵۳.....
۶۸	جدول (۱-۲)، انواع نظریه‌های مربوط به سیکل تجاری.....

۱۶۵	جدول (۱-۵): فهرست نقاط اوج و حضيض طی دوره ۱۳۳۸-۱۳۸۶.....
۱۶۷	جدول (۲-۵): خلاصه نتایج آزمون فرضیه تقارن در شیب به روش دیلانگ و سامرز.....
۱۷۰	جدول (۳-۵): خلاصه نتایج روش گالگاتی.....
۱۷۱	جدول (۴-۵): خلاصه نتایج آزمون عدم تقارن در عمق براساس روش سیشل.....
۱۷۴	جدول (۵-۵): بررسی پایایی متغیرهای الگو بر اساس آزمون دیکي-فولر تعمیم یافته (<i>ADF</i>).....
۱۷۹	جدول (۶-۵)، آزمون متقارن بودن اثر شوک‌های مثبت و منفی نفتی بر ادوار تجاری.....
۱۸۱	جدول (۷-۵)، آزمون متقارن بودن اثر شوک‌های مثبت و منفی نفتی بر ادوار تجاری.....
۱۸۲	جدول (۸-۵)، آزمون متقارن بودن اثر شوک‌های مثبت و منفی نفتی بر ادوار تجاری.....
۱۸۶	جدول (۹-۵)، نتایج آزمون تقارن در شیب و تقارن عمق.....
۱۸۶	جدول (۱۰-۵)، نتایج آزمون نامتقارن بودن شوک‌های مثبت و منفی درآمد نفت.....

فهرست نمودارها

صفحه	عنوان
۱۰	نمودار (۱-۱): نرخ رشد تولید ناخالص داخلی و ارزش افزوده بخش‌های اقتصادی.....
۲۲	نمودار (۲-۱): روند درآمد حاصل از صادرات نفت (میلیون دلار).....
۸۵	نمودار (۱-۲)، چرخه متقارن.....
۸۵	نمودار (۲-۲)، عدم تقارن در شیب تغییرات.....
۸۵	نمودار (۳-۲)، عدم تقارن در عمق.....
۸۶	نمودار (۴-۲)، عدم تقارن در عمق و شیب تغییرات.....
۱۶۰	نمودار (۱-۵) روند زمانی تولید ناخالص داخلی حقیقی از سال ۱۳۳۸-۱۳۸۶.....
۱۶۴	نمودار (۲-۵) روند بلندمدت طی سال‌های ۱۳۳۸-۱۳۸۶.....
۱۶۴	نمودار (۳-۵) ادوار تجاری طی سال‌های ۱۳۳۸-۱۳۸۶.....
۱۶۵	نمودار (۴-۵) جزء نامنظم طی سال‌های ۱۳۳۸-۱۳۸۶.....

گروه: اقتصاد	دانشکده: اقتصاد و علوم اجتماعی	دانشگاه: شهید چمران اهواز
گرایش: نظری		رشته: علوم اقتصادی
عنوان پایان نامه: بررسی عدم تقارن در ادوار تجاری ایران و نقش تکانه‌های نفتی در ایجاد آن		
<p>نگارش: فرزانه پیرو</p> <p>استاد راهنما: دکتر سید عزیز آرمن</p> <p>استاد مشاور: دکتر منصور زراء نژاد</p> <p>تاریخ دفاع: ۱۳۸۹/۶/۲۹ تعداد صفحات: ۲۳۳</p>		
واژگان کلیدی:		
<p>۱- ادوار تجاری ۲- تکانه نفتی ۳- عدم تقارن ۴- روش حداقل مربعات معمولی ۵- مدل لوجیت</p>		
<p>چکیده:</p> <p>در این تحقیق تولید ناخالص داخلی واقعی اقتصاد ایران با بکارگیری فیلتر هادریک- پرسکات به سه جزء روند بلندمدت، نوسانات چرخه‌ای و حرکات نامنظم تفکیک شده است. برای این منظور از داده‌های سالیانه طی دوره ۱۳۸۶-۱۳۳۸، استفاده شده است. بررسی موضوع تقارن و یا عدم تقارن ادوار تجاری هم از لحاظ مبانی نظری الگوهای چرخه‌های اقتصادی و هم به لحاظ کارایی پیش‌بینی الگوهای خطی و هم در تدوین سیاست‌گذاری‌های اقتصادی با توجه به این موضوع که در کدام مرحله از چرخه قرار داریم، بسیار حائز اهمیت است. یافته‌ها وجود احتمالی پدیده‌ی عدم تقارن در ادوار تجاری را تأیید نمی‌کند و از اینرو در اولین تقریب به منظور الگو کردن رفتار ادوار تجاری، می‌توانیم از مدل‌های خطی استفاده کنیم. اهمیت درآمدهای نفتی در اقتصاد ایران و تأثیر آن بر ادوار تجاری، موضوعی غیرقابل انکار است. بنابراین، همچنین به بررسی اثرات نامتقارن تکانه‌های نفتی بر ادوار تجاری ایران و یافتن پاسخ به این سؤال که آیا کاهش درآمدهای نفتی به همان اندازه‌ی افزایش درآمدها ادوار تجاری ایران را متأثر می‌کند، پرداخته می‌شود. یافته‌ها نشان می‌دهد که واکنش ادوار تجاری نسبت به تکانه‌های نفتی، نامتقارن و برای تکانه‌های منفی شدیدتر است. در پایان نیز با استفاده از مدل لوجیت این فرضیه که آیا تکانه‌های نفتی عدم تقارن احتمالی را در ادوار تجاری توضیح می‌دهند، مورد بررسی قرار می‌گیرد. نتایج بدست آمده این فرضیه را تأیید می‌کند.</p>		

کلیات

مقدمه

ادوار تجاری بیان و توضیح تغییر در فعالیت‌های اقتصادی و بازرگانی در طول زمان است. رونق اقتصاد و بازرگانی در قالب کلماتی چون نرخ پایین بیکاری، رشد بالای اقتصادی و فراوانی انواع کالاها همراه با افزایش رفاه مردم نمایش داده می‌شود. کساد و بحران نیز خود را به صورت تشدید بیکاری، فشار زندگی، کاهش شدید سود و افزایش ورشکستگی‌ها نشان می‌دهد. به عبارت دیگر در یک نگاه کلی ادوار تجاری به بررسی نوسان‌های اقتصادی پیرامون مسیر روند بلند مدت می‌پردازد. یعنی هنگام اوج در یک دور تجاری، سطح فعالیت‌های اقتصادی نسبت به روند، بالاتر و در زمان حضيض، فعالیت‌های اقتصادی نسبت به روند، در سطح پایین‌تر قرار می‌گیرد.

متغیرهای عمده اقتصاد کلان نظیر تورم، رشد اقتصادی، بیکاری و ... همگی دارای حرکت‌های ادواری هستند، بنابراین شناخت ادوار تجاری می‌تواند درک مناسب‌تری از ارتباط‌های موجود بین متغیرهای اقتصاد کلان ارائه دهد. اگر چه ادوار تجاری از نظر دامنه، وسعت، قلمرو و طول دوره بسیار متنوع هستند لیکن برخی از اقتصاددانان از جمله رابرت لوکاس^۱ اعتقاد دارند، همه آنها دارای جنبه‌های مشترک فراوانی هستند و بر این اساس می‌توان یک نظریه جامع برای تحلیل آنها ارائه نمود. برخی از این ویژگی‌های مشترک عبارتند از:

الف- تولیدات بخش‌های مختلف اقتصادی (بجز منابع طبیعی و کشاورزی) هم‌جهت تغییر می‌کنند.

ب- تولید کالاهای بادوام و سرمایه‌ای تا حد زیادی تحت تأثیر ادوار تجاری قرار می‌گیرند، این اثرپذیری در مورد کالاهای بی‌دوام کمتر و در مورد خدمات، باز هم محدودتر است.

ج- متغیرهای پولی از جمله سرعت گردش پول، در مرحله رونق دور تجاری افزایش می‌یابند.

د- ادوار تجاری یک پدیده ملی محسوب می‌شود، لیکن در برخی اوقات ممکن است جنبه بین‌المللی نیز پیدا کنند.

برای کنترل دور تجاری دو گرایش در بین اقتصاددانان وجود دارد. گرایش عدم مداخله دولت (کلاسیک‌های جدید) در اقتصاد، معتقد است که دولت باید سیاست پولی ثابت و پایداری را دنبال کرده و کار دیگری با اقتصاد نداشته باشد و خود به وظایف امنیتی، اجتماعی و نظایر آن مشغول باشد. برعکس، گرایش طرفدار مداخله دولت (کینزین‌های جدید)، معتقد است که دولت وظیفه دارد ضمن اینکه رشد متناسب و پایداری برای درآمد و رفاه ملی تضمین می‌نماید در قبال نوسانات فعالیت‌های تجاری بی تفاوت نبوده و با سیاست‌های پولی و مالی مناسب، این نوسانات را به حداقل ممکن برساند.

حال با توجه به آنچه در مورد ادوار تجاری مطرح است می‌توان گفت که تحلیل‌های اقتصادی درباره ادوار تجاری به دو دسته کلی تقسیم می‌گردد، برخی از اقتصاددانان بر تعیین ماهیت و منشأ رکود و رونق اقتصادی تأکید می‌نمایند و گروهی دیگر ضمن جداسازی یک دوره از مسیر بلندمدت، نوسانات حاصل از ادوار تجاری را از ابعادی نظیر دامنه، وسعت، قلمرو، طول دوره و ... مورد بررسی قرار می‌دهند. از طرفی دیگر، اجماع نظری میان اقتصاددانان در ارتباط با تأثیرگذاری تکانه‌های تجاری، خصوصاً تکانه‌های ناشی از تغییر قیمت نفت به عنوان یک کالای استراتژیک که در تولید بسیاری از کالاها به عنوان کالای واسطه نقش دارد، وجود دارد. بررسی آثار تکانه‌های نفتی بر روی متغیرهای کلان اقتصادی نیازمند یک مدل کلان اقتصادی می‌باشد که نحوه تأثیرگذاری درآمدهای نفتی را بر تولید ناخالص داخلی و سایر متغیرهای کلان را در ساختار اقتصادی کشور نشان دهد. اغلب مطالعات انجام شده در این زمینه برای کشورهای صنعتی انجام گرفته، که اکثراً وارد کننده نفت می‌باشند. در این کشورها نفت به عنوان یکی از عوامل تولید بوده و افزایش قیمت آن آثار تورمی و رکودی را در بر داشته است و کاهش قیمت آن به عنوان تکانه

مثبت طرف عرضه محسوب می‌شود. ولی در مطالعات انجام شده برای کشورهای صادرکننده نفت، بیماری هلندی^۱ به عنوان مهمترین مبنای تئوریک موجود محسوب می‌شود

ضرورت تحقیق

تولید ناخالص داخلی واقعی یکی از مهمترین شاخص‌های اقتصادی در یک کشور محسوب می‌شود. این متغیر از سیری هموار برخوردار نبوده بدین معنی که حول روند بلندمدت خود دچار نوسان می‌شود. از آنجایی که مهمترین هدف اقتصاددانان تثبیت اقتصادی و جلوگیری از نوسانات و بی‌ثباتی‌های اقتصاد می‌باشد، شناخت عوامل مؤثر در ایجاد ادوار تجاری قدم اول و اساسی در جهت کنترل نوسانات اقتصادی می‌باشد. تقسیم بندی کلی در رابطه با علل و عوامل بروز ادوار تجاری را می‌توان در غالب نظریات ادوار تجاری برونزا و درونزا معرفی کرد. گروهی معتقدند ادوار تجاری تحت تأثیر عوامل برونزا چون جنگ، بلایای طبیعی، بحران‌های سیاسی و کشاورزی ایجاد می‌شود. در مقابل، گروهی دیگر معتقدند ادوار تجاری ریشه در عوامل درونی چون سرمایه‌گذاری بیش از حد اندازه، مصرف کم و عوامل پولی دارد.

به طور کلی، آنهایی که قائل به برونزا بودن ادوار تجاری هستند معتقدند که اقتصادها اساساً بی‌ثبات نیستند و تا زمانی که دخالت بیرونی از طرف دولت‌ها، بانک‌ها و سایر منابع وجود نداشته باشد اقتصاد هیچ‌گونه دور تجاری را تجربه نخواهد کرد. از طرفی دیگر، طرفداران نظریه دور تجاری درونزا معتقدند که اقتصادها آن قدر پیچیده‌اند که نمی‌توانند بدون دخالت قابل ملاحظه دولت و وضع مقررات دولتی به کار خود ادامه دهند.

اقتصاد تک محصولی ایران و وابستگی شدید آن به درآمدهای نفتی سبب گردیده تا در مقابل تکان‌های بازار نفت در امان نبوده و دستخوش تغییر و نوسان گردد. لذا بررسی ادوار تجاری ایران بدون در نظر گرفتن تکان‌های نفتی و آثار آن امکان پذیر نبوده و به دور از واقعیت می‌باشد.

^۱-Dutch Disease

سؤالات تحقیق

مهمترین سؤالاتی که در این تحقیق مورد بررسی قرار می‌گیرند عبارتند از:

- ۱- آیا ادوار تجاری در اقتصاد ایران نامتقارند؟
- ۲- آیا تکانه‌های نفتی با ادوار تجاری رابطه دارند؟
- ۳- آیا تکانه‌های نفتی قادر به توضیح عدم تقارن در ادوار تجاری هستند؟

فرضیه های تحقیق

براساس سؤالات فوق، فرضیه‌های زیر قابل طرح اند:

- ۱- ادوار تجاری در اقتصاد ایران نامتقارند.
- ۲- تکانه‌های نفتی در ایجاد ادوار تجاری مؤثرند.
- ۳- تکانه‌های نفتی عدم تقارن در ادوار تجاری را توضیح می‌دهند.

اهداف تحقیق

- ۱- بررسی ماهیت ادوار تجاری در اقتصاد ایران.
- ۲- بررسی تقارن یا عدم تقارن در ادوار تجاری ایران.
- ۳- معرفی روش‌های تعیین تقارن و یا عدم تقارن.
- ۴- بررسی نقش درآمدهای نفتی در نوسانات تجاری ایران.
- ۵- اندازه‌گیری نوسانات تجاری نظیر دامنه، وسعت، قلمرو و طول دوره.

روش تحقیق

نوع روش مطالعه

روش تحقیق در این مطالعه از نوع کتابخانه‌ای است. در این روش سعی می‌شود روابط

میان متغیرهای برونزا و درونزا با استفاده از مبانی نظری و مطالعات تجربی مورد بررسی قرار می‌-

گیرد و سپس با استفاده از الگوهای اقتصادسنجی رابطه علی آن ارزیابی می‌شود. سپس با استفاده از آزمون فرضیه‌های آماری صحت نتایج بررسی می‌گردد.

در این رساله تولید ناخالص داخلی به عنوان ترکیبی از روند بلندمدت^۱، چرخه‌های تجاری^۲ و جزء نامنظم^۳ در نظر گرفته می‌شود. سپس با استفاده از فیلتر آماری هادریک و پرسکات^۴ به استخراج جزء روند از سری زمانی تولید ناخالص داخلی واقعی پرداخته و تعداد دوره‌های تجاری در اقتصاد ایران مشخص می‌شود. همچنین به بررسی تأثیر تکانه‌های نفتی در ایجاد ادوار تجاری بر اقتصاد ایران پرداخته می‌شود (در کنار متغیر نفتی، اثر برخی متغیرهای تأثیرگذار چون تکانه پولی، هزینه‌های دولت، صادرات کالاها و خدمات، سرمایه‌گذاری در بخش ساختمان و... نیز بررسی خواهد شد). سپس با بکارگیری شاخص‌های معینی ویژگی‌های ادوار تجاری در ایران به لحاظ طول دوره، وسعت و شدت، تقارن و عدم تقارن آنها مورد بررسی قرار می‌گیرد.

روش یا روشهای گردآوری اطلاعات

آمار مربوط به متغیرهای بکار رفته شده در الگو از دو منبع سال‌نامه‌های آماری بانک مرکزی و نماگرهای اقتصادی بانک مرکزی جمع‌آوری شده است. همچنین آمار مربوط به صادرات نفتی (درآمد نفتی)، از سایت سازمان اوپک اتخاذ شده است.

قلمرو مکانی و زمانی تحقیق

مورد مطالعاتی این رساله ایران و دوره زمانی ۱۳۳۸ تا ۱۳۸۶ است.

1-Long run Trend
2-Business cycles
3-Irregular Fraction
4-Farooq Arby, M.
5-Hodrick and Prescott (1997).

روشهای موردنظر برای تجزیه و تحلیل اطلاعات و آزمون فرضیه‌ها:

با استفاده از روش‌های اقتصادسنجی و بکارگیری سری‌های زمانی پس از بررسی ویژگی‌های آماری متغیرها، روش‌های مناسبی همچون فیلتر هادریک پرسکات به منظور تجزیه تولید ناخالص داخلی واقعی برای تشخیص دوره‌های تجاری در اقتصاد ایران، روش حداقل مربعات معمولی برای بررسی اثرات نامتقارن تکانه‌های نفتی بر ادوار تجاری و روش‌های آزمون عدم تقارن چرخه‌های تجاری همچون دیلانگ و سامرز، سیشل، نفتچی و گالگاتی به منظور بررسی عدم تقارن در ادوار تجاری ایران مورد استفاده قرار خواهد گرفت. همچنین به منظور تجزیه و تحلیل داده‌ها از نرم افزارهای Eviews 6، Microfit 4 و Matlab استفاده خواهد شد.

روند انجام این مطالعه به شرح زیر است:

در فصل اول روند تحولات تولید ناخالص داخلی و رشد اقتصادی کشور طی سال‌های ۱۳۳۸-۱۳۸۶ و روند درآمدهای حاصل از صادرات نفت را مورد بررسی قرار می‌دهیم. در فصل دوم مروری بر ادبیات نظری ادوار تجاری را خواهیم داشت. به این صورت که ابتدا مفهوم ادوار تجاری، حقایق آشکار شده ادوار تجاری، طبقه بندی متغیرهای اقتصادی براساس الگوهای ادوار تجاری، دیدگاه مکتب‌های مختلف پیرامون ادوار تجاری، روش‌های جداسازی چرخه‌های تجاری و ویژگی‌های ادوار تجاری را مطرح خواهیم کرد و سپس به موضوع تقارن و عدم تقارن در چرخه‌های اقتصادی و تکانه و روش‌های اندازه گیری آن می‌پردازیم. فصل سوم به بررسی مطالعات و تحقیقات انجام شده در زمینه ادوار تجاری، ادوار تجاری و شوک‌های نفتی و عدم تقارن در ادوار تجاری می‌پردازد. فصل چهارم روش تحقیق را بیان نموده و در فصل پنجم به ارائه مدل و تجزیه و تحلیل نتایج می‌پردازیم. فصل ششم نتایج کلی و پیشنهادات ارائه خواهد داد.

فصل اول

بررسی روند تولید ناخالص داخلی و درآمد های حاصل از

صادرات نفت

مقدمه

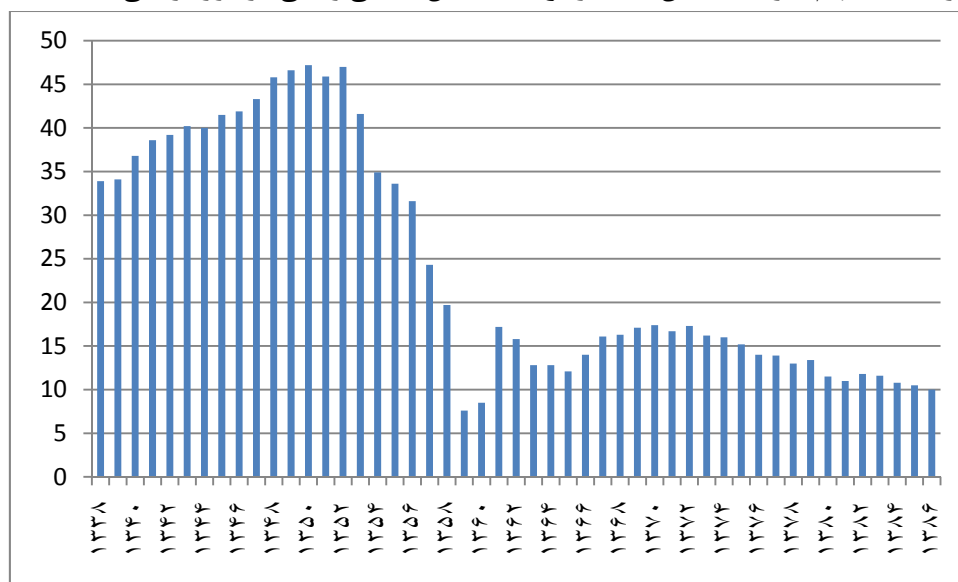
برای تحلیل روند متغیرهای کلان در مرحله اول به بررسی آمارهای خام و در فصل پنجم از سری پردازش شده استفاده می‌شود. طی پنج دهه گذشته روند تولید ناخالص داخلی ایران با فراز و نشیب‌های بسیاری روبرو بوده بطوریکه عوامل داخلی و خارجی مانند شوک‌های نفتی، وقوع انقلاب و بروز جنگ نقش قابل توجهی در شکل‌گیری مسیر حرکت آن داشته‌اند. چون تولید ناخالص داخلی جامع‌ترین معیار سطح فعالیت‌های اقتصادی است، نوسانات آن نیز جایگاه ویژه‌ای در مطالعات ادوار تجاری دارد. از اینرو در این فصل روند آن در ایران طی دوره ۱۳۸۵-۱۳۵۰ بررسی می‌شود. همچنین اقتصاد ایران به عنوان اقتصاد تک محصولی و اقتصاد نفتی، خود گویای وابستگی شدید به درآمدهای نفتی می‌باشد. لذا هر تکانه به صورت افزایش یا کاهش قیمت نفت، اقتصاد ایران را شدیداً دچار تغییر و تحول نموده و می‌تواند زمینه ایجاد ادوار تجاری به صورت مراحل رونق و رکود را در اقتصاد به همراه داشته باشد. از اینرو روند درآمدهای حاصل از صادرات نفت در اقتصاد ایران طی سال‌های ۱۳۸۵-۱۳۳۳ و تأثیر تکانه‌های انرژی بر اقتصاد نیز مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

۱-۱- بررسی روند تحولات تولید ناخالص داخلی و رشد اقتصادی کشور

نکته قابل توجه در بررسی تولید ناخالص داخلی، تأثیر بخش‌های مختلف اقتصادی در تولید کل کشور است. یعنی اینکه سهم بخش کشاورزی، صنایع و معادن، نفت و خدمات در ایجاد تولید ناخالص داخلی چقدر است و سهم هر بخش چگونه تغییر یافته است. نمودار (۱-۱) سهم بخش نفت را شکل‌گیری تولید ناخالص داخلی واقعی در دوره زمانی ۱۳۸۶-۱۳۳۸ نشان می‌دهد. براساس جدول (۱-۱) ملاحظه می‌شود میانگین نرخ رشد تولید ناخالص داخلی حقیقی طی دوره زمانی ۱۳۸۶-۱۳۳۹، ۵/۴۳ درصد در سال و انحراف معیار آن ۶/۹۶ درصد است. همچنین میانگین نرخ

رشد تمام بخش‌ها مثبت و میانگین رشد بخش صنایع و معادن از سایر بخش‌ها بیشتر است. افزون بر آن در جدول (۱-۱)، نوسانات اقتصاد ایران با استفاده از انحراف معیار مورد بررسی قرار گرفته است. بنابراین همانطور که مشاهده می‌شود، تغییرات بخش نفت از دیگر بخش‌ها بیشتر بوده است و این موضوع اهمیت بررسی نوسانات بخش نفت در مطالعه ادوار تجاری را مشخص می‌کند.

نمودار (۱-۱): سهم (درصد) بخش نفت در تولید ناخالص داخلی واقعی در دوره زمانی ۱۳۳۸-۱۳۸۶



مأخذ: بانک مرکزی ایران

جدول (۱-۱): بررسی رشد تولید ناخالص داخلی با استفاده از میانگین نرخ رشد و انحراف معیار

دوره زمانی ۱۳۳۹-۱۳۸۶	میانگین	انحراف معیار
رشد تولید ناخالص داخلی	۵/۴۳	۶/۹۶
رشد بخش نفت	۵/۰۷	۲۳/۵۷
رشد بخش صنایع و معادن	۸/۶	۱۰/۷۴
رشد بخش کشاورزی	۴/۴۸	۴/۴۵
رشد بخش خدمات	۶/۰۲	۸/۲۴

مأخذ: محاسبات تحقیق با استفاده از داده‌های بانک مرکزی