



مدیریت تحصیلات تکمیلی مرکز تهران

رساله

برای دریافت مدرک دکتری تخصصی (Ph.D)

علوم اقتصادی

بررسی تأثیر بی ثباتی صادرات

بر سرمایه گذاری و رشد اقتصادی ایران

مهدی حقگو

اساتید راهنما:

دکتر جهانگیر بیابانی

دکتر بیتا شایگانی

استاد مشاور اول: دکتر اصغر ابوالحسنی هستیانی

استاد مشاور دوم: دکتر کامران ندری

خرداد ۱۳۹۲





دانشگاه پیام نور

مدیریت تحصیلات تکمیلی مرکز تهران

رساله

برای دریافت مدرک دکتری تخصصی (Ph.D)

علوم اقتصادی

بررسی تأثیر بی ثباتی صادرات

بر سرمایه گذاری و رشد اقتصادی ایران

مهدی حقگو

اساتید راهنما:

دکتر جهانگیر بیابانی

دکتر بیتا شایگانی

استاد مشاور اول: دکتر اصغر ابوالحسنی هستیانی

استاد مشاور دوم: دکتر کامران ندری

خرداد ۱۳۹۲



صور تجلسه دفاع از رساله دکتری تخصصی
Ph.D.

جلسه دفاع از رساله دوره دکتری تخصصی آقای مهدی حقیگو دانشجوی رشته علوم اقتصادی به شماره دانشجویی ۸۶۹۱۰۱۱۱۱ تحت عنوان " بررسی تاثیر پی ثباتی صادرات بر سرمایه گذاری و رشد اقتصادی در ایران " با حضور هیات داوران در روز چهارشنبه مورخ ۱۳۹۲/۰۳/۲۲ ساعت ۱۶ در محل ساختمان مرکز تحصیلات تکمیلی برگزار شد و هیات داوران پس از بررسی، رساله مذکور را شایسته نمره به عدد ۱۹..... و به حروف **نوزده** و با درجه **عالی** تشخیص داد.

| ردیف | نام و نام خانوادگی | هیات داوران | مرتبه دانشگاهی | دانشگاه/موسسه | امضاء |
|------|--------------------|------------------------|----------------|---------------|-------|
| ۱ | دکتر بیابانی | استاد راهنما | استاد | پیام نور | |
| ۲ | دکتر شایگانی | استاد راهنما | استاد | پیام نور | |
| ۳ | دکتر ابوالحسنی | استاد مشاور | استاد | پیام نور | |
| ۴ | دکتر ندری | استاد مشاور | استاد | پژوهشگاه پدپ | |
| ۵ | دکتر تقوی | استاد داور | استاد | مدرس | |
| ۶ | دکتر لشکری | استاد داور | استاد | پیام نور | |
| ۷ | زهره شادفر | نماینده تحصیلات تکمیلی | | | |

تهران، خیابان فرمانیه
خیابان دیباجی شمالی
خیابان شهید
حاج محمود نوریان
کوچه شهناز، کوچه صفا

تلفن: ۰۲۱)۲۲۲۹۵۷۴۷

دورنگار: ۰۲۱)۲۲۸۰۸۴۹۴

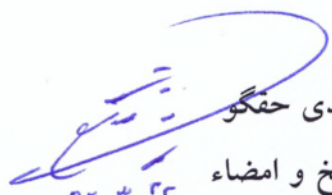
پست الکترونیک:

info@phd.pnu.ac.ir

نشانی الکترونیک:

WWW.phd.pnu.ac.ir

اینجانب مهدی حقگو دانشجوی ورودی سال ۱۳۸۶ مقطع دکتری تخصصی رشته علوم اقتصادی گواهی می‌نمایم چنانچه در رساله خود از فکر، ایده و نوشته دیگری بهره گرفته‌ام با نقل قول مستقیم و یا غیرمستقیم منبع و مأخذ آن را نیز در جای مناسب ذکر کرده‌ام. بدیهی است مسئولیت تمامی مطالبی که نقل قول دیگران نباشد بر عهده خویش می‌دانم و جوابگویی آن خواهم بود.


مهدی حقگو
تاریخ و امضاء
۹۲، ۳، ۲۲

سپاسگزاری

بیش و بیش از هر چیز پروردگار بزرگ را شاکرم که توفیق داد در راه علم و دانش گامی کوچک بردارم و چشمانم را به نور علم روشنایی و دستانم را به فضیلت قلم آشنایی داد و از آنجا که تشکر از کسانی که راه رسیدن به الطاف الهی را هموار نموده و واسطه فیض شده‌اند، وظیفه‌ای است که مورد سفارش خدا و اولیاء دین می‌باشد، چه اینکه در جلد ۷۱ بحارالانوار از حضرت امام رضا (ع) نقل شده: «مَنْ لَمْ يَشْكُرِ الْمُنْعَمَ مِنَ الْمَخْلُوقِينَ لَمْ يَشْكُرِ اللَّهَ عَزَّ وَجَلَّ»؛ هر که سپاس نعمت‌دهنده از آفریدگان را نکند، خداوند را سپاس نکرده است؛ از این رو بر خود فرض می‌دانم تا از مشوقان اصلی خود در این راه، یعنی مادر بزرگووارم، همسر گرامی‌ام و فرزندان دلبندم کمال تشکر را ابراز دارم. همچنین از استادان ارجمند جناب آقای دکتر بیابانی و سرکار خانم دکتر شایگانی تشکر فراوان می‌کنم که پژوهش انجام شده را مرهون کمک و راهنمایی‌های ایشان می‌دانم و از جناب آقای دکتر ابوالحسنی هستیانی و جناب آقای دکتر ندری که با مشاوره‌های علمی خود بر غنای پژوهش حاضر افزودند و جناب آقای دکتر تقوی، جناب آقای دکتر لشکری و سرکار خانم شادفر که داوری و نظارت بر این پژوهش را پذیرفتند، بسیار سپاسگزارم. در پایان از همه افرادی که در تمامی مراحل زندگی، مرا یاری نموده‌اند، تشکر می‌نمایم.

چکیده

اهمیت و نقش صادرات در رشد و توسعه اقتصادی و تأثیر آن بر بخش های اقتصادی مسئله بسیار مهم و گسترده ای است که در حال حاضر مورد توجه بسیاری از اندیشمندان اقتصادی واقع شده و در سایر حوزه های علوم نیز گسترش قابل ملاحظه ای داشته است. از این رو بی ثباتی صادرات به عنوان یکی از فاکتورهای اثربخش در مدل های اقتصاد کلان و از طرف دیگر به عنوان یکی از متغیرهای اساسی در الگوهای مدیریتی ریسک و بازده مورد توجه سیاستگذاران بوده است. هدف اصلی این مطالعه بررسی تأثیر بی ثباتی صادرات و نا اطمینانی آن بر رشد تولید ناخالص ملی در ایران براساس اطلاعات بازه زمانی ۱۳۸۹-۱۳۵۴ می باشد. برای این منظور ابتدا شاخص بی ثباتی صادرات از طریق شاخص قدرمطلق انحراف صادرات از میانگین متحرک پنج ساله (مدل لاو (۱۹۹۲)) محاسبه ، سپس با بهره گیری از مدل واریانس ناهمسانی شرطی خود رگرسیو تعمیم یافته GARCH نااطمینانی صادرات تعیین و در ادامه با استفاده از روش خودرگرسیون با وقفه توزیعی گسترده (ARDL) تأثیر متغیرهای مدل بررسی شده است. براین اساس بی ثباتی و نا اطمینانی صادرات تأثیر منفی بر تولید داشته به طوری که این تأثیر در کوتاه مدت بیشتر از اثر آن در بلند مدت بوده است که هم جهت با فرضیه تحقیق می باشد.

واژگان کلیدی : رشد اقتصادی، بی ثباتی صادرات، سرمایه گذاری، الگوی تصحیح خطای ECM.

طبقه بندی JEL : E23 , F43 , O40.

فهرست مطالب

| عنوان | صفحه |
|---|------|
| فصل اول..... | ۱ |
| کلیات تحقیق..... | ۱ |
| ۱-۱- مقدمه..... | ۱ |
| ۲-۱- شرح مسئله و اهمیت موضوع..... | ۵ |
| ۳-۱- اهداف و فرضیه های تحقیق..... | ۷ |
| ۴-۱- روش انجام تحقیق..... | ۹ |
| ۵-۱- ساختار تحقیق..... | ۱۰ |
| فصل دوم..... | ۱۱ |
| مبانی نظری و پیشینه تحقیق..... | ۱۱ |
| ۱-۲- مقدمه..... | ۱۲ |
| ۲-۲- صادرات و بی ثباتی آن..... | ۱۳ |
| ۳-۲- بی ثباتی صادرات و رشد اقتصادی..... | ۱۵ |
| ۴-۲- تئوریا و مدل های رشد..... | ۲۵ |
| ۲-۴-۱- مدل سولو، اسوان..... | ۲۵ |
| ۲-۴-۲- مدل رشد دورن زا رومر- لوکاس..... | ۳۶ |
| ۲-۴-۳- الگوی رشد سنت لوئیس..... | ۴۱ |
| ۲-۵- تصریح مدل..... | ۴۵ |
| ۲-۶- مروری بر تحقیقات انجام شده..... | ۴۷ |
| ۲-۶-۱- مطالعات انجام گرفته در خارج..... | ۴۸ |
| ۲-۶-۲- مطالعات انجام گرفته در داخل..... | ۵۹ |
| فصل سوم..... | ۶۴ |
| روش تحقیق..... | ۶۴ |
| ۱-۳- مقدمه..... | ۶۵ |
| ۲-۳- الگوی خودرگرسیون با وقفه توزیعی گسترده (ARDL)..... | ۶۷ |
| ۳-۲-۱- آزمون کرانه ها..... | ۶۸ |
| ۳-۲-۲- آزمون برون زایی وو و هاسمن..... | ۷۴ |
| ۳-۳- بی ثباتی صادرات..... | ۷۷ |
| ۳-۴- نا اطمینانی صادرات..... | ۷۹ |

فهرست مطالب

| عنوان | صفحه |
|--|------|
| فصل چهارم..... | ۸۱ |
| یافته های تحقیق..... | ۸۱ |
| ۱-۴- مقدمه..... | ۸۲ |
| ۲-۴- نتایج آزمون ریشه واحد..... | ۸۲ |
| ۳-۴- تحلیل نتایج الگو..... | ۸۴ |
| ۳-۴-۱- نتایج الگوی خود توضیح با وقفه های توزیعی بی ثباتی صادرات..... | ۸۴ |
| ۳-۴-۱-۱- نتایج برآورد الگوی بلندمدت..... | ۸۷ |
| ۳-۴-۱-۲- نتایج برآورد الگوی تصحیح خطا..... | ۸۸ |
| ۳-۴-۱-۳- نتایج آزمون کرانه ها..... | ۹۰ |
| ۳-۴-۱-۴- نتایج آزمون ثبات ساختاری..... | ۹۰ |
| ۳-۴-۲- نتایج الگوی خود توضیح با وقفه های توزیعی نااطمینانی صادرات..... | ۹۳ |
| ۳-۴-۲-۱- نتایج برآورد الگوی بلندمدت..... | ۹۵ |
| ۳-۴-۲-۲- نتایج برآورد الگوی تصحیح خطا..... | ۹۶ |
| ۳-۴-۲-۳- نتایج آزمون کرانه ها..... | ۹۸ |
| ۳-۴-۲-۴- نتایج آزمون ثبات ساختاری..... | ۹۸ |
| فصل پنجم..... | ۱۰۱ |
| جمع بندی و نتیجه گیری و ارائه پیشنهادها..... | ۱۰۱ |
| ۱-۵- مقدمه..... | ۱۰۲ |
| ۲-۵- نتیجه گیری..... | ۱۰۲ |
| ۳-۵- پیشنهادها..... | ۱۰۳ |
| منابع فارسی..... | ۱۰۵ |
| منابع لاتین..... | ۱۰۸ |
| پیوست (۱) جدول آمارها..... | ۱۱۳ |
| پیوست (۲) خروجی نرم افزار ایویوز نتایج مدل های GARCH..... | ۱۱۴ |
| پیوست (۳) خروجی نرم افزار ایویوز آزمون ایستایی متغیرها..... | ۱۱۶ |
| پیوست (۴) خروجی نرم افزار ماکروفیت برآورد مدل بی ثباتی صادرات..... | ۱۵۰ |
| پیوست (۵) خروجی نرم افزار ماکروفیت برآورد مدل نا اطمینانی صادرات..... | ۱۵۳ |
| پیوست (۶) نتایج آزمون کرانه پسران و همکاران (۲۰۰۱) مدل بی ثباتی صادرات..... | ۱۵۶ |
| پیوست (۷) نتایج آزمون کرانه پسران و همکاران (۲۰۰۱) مدل نا اطمینانی صادرات..... | ۱۵۹ |

فهرست مطالب

صفحه

عنوان

| | |
|---|-----|
| پیوست (۸) نتایج آزمون برون زایی ضعیف وو و هاسمن مدل بی ثباتی صادرات..... | ۱۶۲ |
| پیوست (۹) نتایج آزمون برون زایی ضعیف وو و هاسمن مدل نا اطمینانی صادرات..... | ۱۶۳ |

فهرست جداول

| صفحه | عنوان |
|------|--|
| ۸۳ | جدول (۳-۱) آزمون وجود اثر ARCH..... |
| ۸۳ | جدول (۴-۱) آزمون ایستایی متغیرها..... |
| ۸۵ | جدول (۴-۲) نتایج الگوی خودتوضیح با وقفه های توزیعی مدل بی ثباتی صادرات براساس معیار شوارتز - بیزین..... |
| ۸۷ | جدول (۴-۳) نتایج آزمون تشخیصی مدل بی ثباتی صادرات..... |
| ۸۸ | جدول (۴-۴) نتایج رابطه بلندمدت مدل بی ثباتی صادرات..... |
| ۸۹ | جدول (۴-۵) نتایج برآورد الگوی تصحیح خطای مدل بی ثباتی صادرات..... |
| ۹۰ | جدول (۴-۶) مقادیر آزمون کرانه های مدل بی ثباتی صادرات..... |
| ۹۳ | جدول (۴-۷) نتایج الگوی خودتوضیح با وقفه های توزیعی مدل نا اطمینانی صادرات براساس معیار شوارتز - بیزین..... |
| ۹۵ | جدول (۴-۸) نتایج آزمون تشخیصی مدل نا اطمینانی صادرات..... |
| ۹۶ | جدول (۴-۹) نتایج رابطه بلندمدت مدل نا اطمینانی صادرات..... |
| ۹۷ | جدول (۴-۱۰) نتایج برآورد الگوی تصحیح خطای مدل نا اطمینانی صادرات..... |
| ۹۸ | جدول (۴-۱۱) مقادیر آزمون کرانه های مدل نا اطمینانی صادرات..... |

فهرست نمودارها

صفحه

عنوان

| | |
|-----|---|
| ۲۹ | شکل (۲-۱) برابری سرمایه گذاری واقعی با سرمایه گذاری سربه سر |
| ۳۰ | شکل (۲-۲) منحنی فازی k در الگوی سولو |
| ۳۱ | شکل (۲-۳) اثرات افزایش نرخ پس انداز بر سرمایه گذاری |
| ۳۳ | شکل (۲-۴) اثرات افزایشی در نرخ پس انداز |
| ۴۲ | شکل (۲-۵) نمودار جریانی الگوی سنت لوئیس |
| ۹۱ | شکل (۴-۱) نتایج آزمون مجموع انباشته جملات پسماند بازگشتی مدل بی ثباتی صادرات |
| ۹۲ | شکل (۴-۲) نتایج آزمون مجموع انباشت مربعات جملات پسماند بازگشتی مدل بی ثباتی صادرات |
| ۹۹ | شکل (۴-۳) نتایج آزمون مجموع انباشت جملات پسماند بازگشتی مدل نا اطمینانی صادرات |
| ۱۰۰ | شکل (۴-۴) نتایج آزمون مجموع انباشت مربعات جملات پسماند بازگشتی مدل نا اطمینانی صادرات |

فصل اول

کلیات تحقیق

۱-۱- مقدمه

یکی از مهمترین اجزای فعالیت های اقتصادی بخش تجارت خارجی است که در نتیجه پیشرفت های تکنولوژیک و وجود برتری های نسبی در تولید کالا و خدمات و تنوع آن ها روز به روز بر اهمیت این بخش افزوده گشته است. شواهد نظری حاکی از تأثیر مثبت تجارت بر رشد اقتصادی است و تجربه بسیاری از کشورهای جهان نشان از توسعه اقتصادی به موجب حضور در بازارهای جهانی و استفاده از مزیت های نسبی در داد و ستدها دارد (افروز، ۱۳۹۰ : ۴۲).

از جمله خصایص مشترکی که در اغلب کشورهای در حال توسعه مشهود است متکی بودن این کشورها به درآمدهایی است که صرفاً از صادرات مواد خام حاصل می گردد که صرف نظر از ارزش افزوده پایین آنها شدیداً تحت تأثیر نوسانات قیمتی در بازارهای جهانی است. در واقع این کشورها بدون اینکه بتوانند تأثیر به سزایی در قیمت این نوع از کالاها داشته باشند، عملاً قیمت به عنوان یک عامل برون زا بر این کشورها تحمیل می گردد.

یکی دیگر از خصیصه های کشورهای در حال توسعه عدم تنوع کالا در سبد کالای صادراتی آنان می باشد که به همین خاطر قادر نیستند انعطاف لازم را در جبران و یا کاهش ضربه پذیری ناشی از نوسان قیمت یک یا چند کالای صادراتی شان در تجارت بین الملل داشته باشند. همچنین عدم توانایی در بازاریابی و وجود تمرکز در جغرافیای صادراتی شان که اغلب به بازارهای محدود منطقه ای منتج شده همگی مؤید تأثیر پذیری اقتصاد این کشورها از نوسانات قیمتی می باشد.

مطالعات کاربردی زیادی در خصوص چگونگی اثرات نوسانات ناشی از بی ثباتی و یا نا اطمینانی صادرات بر تولید و رشد اقتصادی کشورهای در حال توسعه صورت پذیرفته است و به نتایج متفاوتی

نیز نائل آمده اند. از جمله دلایلی که می توان برای یکسان نبودن نتایج این محققان بیان نمود، عبارتند از: اولاً شاخص های بی ثباتی که این محققان در بررسی های خود از آن بهره برده اند متفاوت بوده که به احتمال زیاد در نتایج حاصله مؤثر بوده است. ثانیاً این مطالعات در دوره های زمانی مختلفی صورت پذیرفته است که احتمالاً نتایج تحت تأثیر این دوره ها قرار گرفته است. ثالثاً برخی از این مطالعات با استفاده از داده های مقطعی کشورهای درحال توسعه سعی در بررسی چگونگی اثرات این نوسانات بر تولید و رشد اقتصادی داشته اند درحالی که برخی دیگر از این مطالعات با استفاده از داده های سری زمانی مربوط به یک کشور خاص مورد بررسی قرار گرفته اند. بنابراین با توجه به این ویژگی ها و الگوهای متفاوتی که در بررسی ها بکار گرفته شده، بدست آمدن نتایج متفاوت دور از انتظار نبوده است. علاوه بر آنچه که ذکر گردید، از لحاظ تئوری نظریات اقتصاددانان درخصوص رابطه بین نوسانات صادرات و رشد اقتصادی کشورهای درحال توسعه به سه دسته تقسیم بندی می شود:

گروه اول^۱ بر این باورند که بی ثباتی به سبب ایجاد عدم تعادل در برنامه ریزی های بلند مدت موجب کمبود منابع تولیدی، کاهش واردات کالاهای واسطه ای و سرمایه ای (که دارای وابستگی زیادی به ارز حاصل از صادرات می باشند)، انتقال منابع از یک بخش به بخش دیگر، کاهش سطح سرمایه گذاری و در نتیجه کاهش تولید و رشد اقتصادی می گردد. در مقابل گروه دیگر^۲ با این استدلال که عدم اطمینان ناشی از نوسانات درآمدهای صادراتی باعث افزایش تقاضای احتیاطی پول شده و آن نیز به نوبه خود به مقدار پس انداز بخش خصوصی می افزاید، معتقدند اگر این افزایش

^۱- Glezakos: Adams , Behrman & Roldon

^۲- MCBean: Obidegwv , Nziramasanga ; Savvides

پس انداز به سمت سرمایه گذاری های مولد هدایت و سوق داده شود می تواند موجبات رونق بخشیدن به طرح های تولیدی، افزایش تولید و رشد اقتصادی ملی را فراهم آورد. دسته دیگری¹ از اقتصاددانان به هیچ رابطه ای بین بی ثباتی صادرات و رشد اقتصادی در کشورهای در حال توسعه معتقد نیستند. استدلال این گروه بر این فرض متکی می باشد که بی ثباتی در کشورهای در حال توسعه و صادر کننده مواد اولیه قابل پیش بینی بوده لذا سیاستگذاران می توانند با برنامه ریزی های مناسب اثرات بی ثباتی صادرات بر تولید و رشد اقتصادی را خنثی نمایند.

ایران به عنوان یکی از کشورهای در حال توسعه در شرایطی قرار دارد که عمده درآمدهای ارزی از محل صدور کالاهای نفتی و غیرنفتی تأمین می گردد. از طرف دیگر عمده شرکای تجاری ایران محدود به چند کشور از جمله امارات، چین، آلمان، ایتالیا، فرانسه و ژاپن می باشد، لذا خصیصه تمرکز کالایی و تمرکز جغرافیائی در اقتصاد ایران مشهود است. بدین خاطر درآمدهای صادراتی ایران اغلب دستخوش تغییرات ناگهانی و سریع قیمت های جهانی بوده و از ثبات لازم برخوردار نبوده است و این معضل درآمدهای ارزی ایران را دستخوش نوسان هائی نموده است. با توجه به این خصیلت ها، شرایط اقتصادی ایران به گونه ای است که پیوسته تحت تأثیر نوسانات حاصل از صادرات بالاخص صادرات نفت بوده و از این رو بررسی اثر بی ثباتی صادرات بر تولید و رشد اقتصادی حائز اهمیت می باشد. در ادامه در بخش دوم به شرح مسئله و اهمیت موضوع می پردازیم.

¹ - Yotopoulos & Nvgent

۱-۲- شرح مسئله و اهمیت موضوع

بررسی و مطالعه صادرات در اقتصاد ایران و تأثیر آن بر بخش های اقتصادی مسئله ای بسیار مهم می باشد که حتی گسترش آن در حوزه های دیگر مانند جامعه شناسی، علوم سیاسی و حتی مسایل فنی بسط قابل ملاحظه ای داشته است. طبق نظریه بالاسا (۱۹۸۵)^۱ مواردی نظیر مدیریت مؤثر، تکنولوژی تولیدی بهبود یافته و تخصص در رقابت که در سایه وسعت صادرات و ایجاد برون نگری مثبت حاصل از آن بدست می آیند موجب سرعت بخشیدن به رشد اقتصادی می شوند. درآمد ناشی از صادرات به ویژه در کشورهای نفت خیز نظیر ایران سهم قابل ملاحظه ای در وضعیت اقتصادی کشور دارد. این درآمدها از سویی سهم عمده ای از نیازهای ارزی کشور را تأمین می نماید و از سوی دیگر تأمین کننده اصلی مخارج دولت است. اصولاً در چنین کشورهایی برنامه ریزی توسعه نیاز شدید به چنین درآمدهایی دارد. تحقق نیافتن درآمدهای پیش بینی شده می تواند قسمتی از برنامه های توسعه را تعطیل نماید و در عمل مانع دستیابی اقتصاد به نرخ رشد مورد انتظار گردد.

افزایش درآمدهای صادراتی بیش از مقادیر پیش بینی شده (که روند باثبات تعریف می گردد) ممکن است نتایج متفاوتی به دنبال داشته باشد. مازاد درآمدهای ایجاد شده می تواند به افزایش توان اقتصاد کشور منجر گردد و به طرح ها و برنامه هایی اختصاص پیدا کند که به توسعه بیشتر کشور بیانجامد و از سویی دیگر ممکن است کشور را در دام برنامه های بلندپروازانه گرفتار نماید و سبب شود عدم تعادل های اقتصادی نظیر کسری بودجه، کسری تراز پرداخت ها، کسری بازرگانی خارجی و حتی شکاف سرمایه گذاری- پس انداز بیشتر گردد. از طرفی براساس تئوری های تجارت بین

^۱ -Balasa (1985).

الملل، کشورهای درحال توسعه به دلیل برخورداری از مزیت های نسبی و فراوانی نمادهای تولیدی از تخصص های اولیه اقتصادی منتفع می گردند. درعین حال برخی از اقتصاددانان توسعه تخصص گرایی بین المللی^۱ را به لحاظ وابستگی شدید اقتصاد به کالاهای صادراتی مورد انتقاد قرار می دهند. اینان معتقدند که تخصص گرایی بین المللی در کالا برای یک کشور منجر به وابستگی شدید اقتصاد آن کشور به درآمدهای صادراتی می شود و به دلیل غیرقابل پیش بینی بودن قیمت کالاهای صادراتی در صورت نوسانات شدید قیمتی این امر به بی ثباتی درآمدهای صادراتی می انجامد و این مسئله تأثیر منفی بر کل اقتصاد خواهد گذاشت. به عبارت دیگر به لحاظ اینکه سهم اعظمی از واردات را در کشورهای درحال توسعه کالاهای سرمایه ای و واسطه ای (که به عنوان یک نهاده تولیدی استفاده می گردند) تشکیل می دهد و منابع تأمین مالی این نوع از واردات از محل درآمدهای صادراتی تأمین می شود، لذا بی ثباتی درآمدهای صادراتی به اختلال در واردات این نوع از نهاده های تولیدی منجر شده و به تبع آن رشد اقتصادی کشور را تحت تأثیر قرار می دهد.^۲ پرسش بعدی در این نوع از تجزیه و تحلیل چگونگی تأثیر بی ثباتی صادرات بر رفاه تولیدکنندگان است. مطالعات پیشرو در پاسخ به این پرسش از مفاهیم مازاد کالایی مارشالی سستی استفاده نموده اند. ادبیات اقتصادی در پاسخ به آن ترجیحاً از تجزیه و تحلیل هزینه فایده استفاده نموده است. بدین ترتیب در این حالت هزینه ریسک به عنوان میزانی که تولیدکنندگان جهت اجتناب از بی ثباتی از طریق طرح بیمه رسمی یا غیررسمی (جهت پوشش ریسک ابتدایی) تمایل به پرداخت دارند تعریف می گردد. هزینه ریسک نیز به نحوه رفتار و نگرش بنگاه به ریسک بستگی دارد. به عنوان مثال اگر بنگاه ریسک گریز باشد، هزینه ریسک

1- International Specialization.

2-Feder (1982),Sinha (1999).

همبستگی مثبت با آن خواهد داشت. اما وجود هزینه بالای ریسک به این معنا که می بایستی فرآیند تثبیت به لحاظ روند چنین هزینه هایی هم در سطح ملی و هم در سطح بین المللی اجرا گردد، نمی باشد. بنابراین تحلیل دقیق این مسائل برای کشور ایران که با توجه به درآمد نفت امکان لازم را برای وسعت بخشیدن به تجارت بین المللی دارد بسیار حائز اهمیت است، زیرا این بخش از اقتصاد ملی دارای تأثیر پذیری بسیار زیادی در شرایط بحرانی و یا حتی غیربحرانی می باشد. امروزه تأثیرات و نوسانات قیمت نفت برای هر ایرانی مهم است. بسیاری از روابط جاری و عادی در اقتصاد کشور متأثر از اخبار حاصل از تعیین قیمت نفت کشور است. بسیاری از بازرگانان و تجار در شرایطی که ممکن است آشنایی مختصری نیز از روابط کلان اقتصادی نداشته باشند چشم به قیمت نفت و دیگر کالاهای صادراتی دوخته و ممکن است خرید و فروش کالا را با نیم نگاهی به نوسانات قیمت این قبیل کالاها معطوف نمایند و این امر نشان دهنده حساسیت جامعه به مسئله نوسانات یا بی ثباتی درآمدهای ناشی از صادرات می باشد.

۳-۱- اهداف و فرضیه های تحقیق

اهداف این تحقیق عبارتند از:

- ۱- بررسی تأثیر نوسانات صادرات در قالب شاخص های تعریف شده در بحث بی ثباتی و ناطمینانی بر رشد اقتصادی.
- ۲- میزان تأثیر گذاری نوسانات صادرات نفتی و غیر نفتی به تفکیک بر رشد اقتصادی.
- ۳- بررسی تأثیر بخش واقعی و پولی اقتصاد بر رشد اقتصادی .

بدین ترتیب با درک صحیح و شناخت درست ماهیت و عمل بی ثباتی می توان در جهت رفع و یا هدایت آن به بخش هایی که اثرات جانبی کمتری به بار می آورد اقدام و از پیامدهای آن بر کل اقتصاد جلوگیری کرده و یا آنها را محدود نمود. لذا تأثیر بی ثباتی و نا اطمینانی صادرات نفتی و غیرنفتی بر رشد اقتصادی در دو بعد زمانی کوتاه مدت و بلند مدت در اقتصاد ایران در قالب مدل رشد درون زا با استفاده از رهیافت آزمون کرانه ها جهت تعیین روابط بلند مدت و مدل خود بازگشتی با وقفه های توزیعی^۱ برای تعیین اثرات همزمان بی ثباتی و نا اطمینانی صادرات نفتی و غیر نفتی بر رشد اقتصادی با استفاده از داده های سری زمانی مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

بطور کلی سئوالاتی که در این تحقیق به آنها پاسخ داده خواهد شد عبارتند از :

۱- آیا بی ثباتی و نا اطمینانی صادرات نفتی و غیرنفتی تأثیر معنی داری بر رشد اقتصادی در کشور

ایران دارد؟

۲- آیا این تأثیر در بلند مدت متفاوت از اثرات آن در کوتاه مدت است؟

۳- تأثیر سایر متغیرهای توزیعی مانند شاخص پولی در اقتصاد ایران چگونه است؟

باتوجه به مطالعات تجربی صورت گرفته و ساختار اقتصادی کشور ایران پیش بینی محقق در

رابطه با فرضیه های تحقیق عبارتند از:

۱- در اقتصاد ایران بی ثباتی و نا اطمینانی صادرات تأثیر منفی بر رشد اقتصادی دارد.

۲- تأثیر بی ثباتی و نا اطمینانی صادرات در کوتاه مدت با اثر آن در بلند مدت متفاوت است.

۳- با توجه به اثرات تورمی حجم پول ، شاخص پولی بر رشد اقتصادی تأثیر منفی دارد.

^۱ - ARDL