





دانشگاه آزاد اسلامی
واحد تهران مرکزی

دانشکده اقتصاد و حسابداری

پایان نامه برای دریافت درجه کارشناسی ارشد (M.A)

گرایش: علوم اقتصادی

عنوان:

اثر هدفمندی یارانه انرژی بر متغیرهای کلان اقتصادی

استاد راهنما:

دکتر منیژه هادی نژاد دارسرا

استاد مشاور:

دکتر تیمور محمدی

پژوهشگر:

عظیم نادری

بهار ۱۳۹۱

تقدیم به:

همسر مهربانم که وجودش تفسیر زیبایی و آرامش ، نگاهش تعبیری از عشق و مهر و محبت است.

قدرداني و تشكر:

از تلاش‌ها و راهنمايي‌هاي ارزشمند استاد ارجمند سرکار خانم دكتر منيژه هادي نژاد دارسرا
که راهنمايي اين پايان نامه را بعهده داشته‌اند قدرداني و تشكر ميکنم.
از راهنمايي‌هاي ارزنده استاد ارجمند جناب آقاي دكتر تيمور محمدي که در مراحل اين پژوهش
اينجانب را ياري کرده‌اند بسيار متشكرم.
از جناب آقاي دكتر ابراهيم عباسي که داوري اين پايان نامه را بعهده گرفته اند تشكر و قدرداني
ميکنم.

تعه‌دنامه اصالت پاياننامه کارشناسي ارشد
اينجان‌ب عظيم نادري دانش آموخته مقطع کارشناسي ارشد ناپيوسته به شماره
دانشجويي ۸۷۰۸۵۰۲۶۶۰۰ در رشته علوم اقتصادي که در تاريخ ۹۱/۰۳/۱۱ از پاياننامه
خود تحت عنوان: اثر هدمندي يارانه انرژي بر متغيرهاي کلان اقتصادي با کسب نمره ۱۹ و
درجه عالي دفاع نمودهام بدینوسيله متعهد ميشوم:

۱ - اين پاياننامه حاصل تحقيق و پژوهش انجام شده توسط اينجان‌ب بوده و در مواردی که از
دستاوردهاي علمي و پژوهشي ديگران (اعم از پايان نامه، کتاب، مقاله و...) استفاده نمودهام
مطابق ضوابط و رويههاي موجود، نام منبع مورد استفاده و ساير مشخصات آن را در فهرست
ذکر و درج کردهام.

۲ - اين پاياننامه قبلاً براي دريافت هيچ مدرک تحصيلي (هم سطح، پايين‌تر يا بالاتر) در ساير
دانشگاه‌ها و موسسات آموزش عالي ارائه نشده است.

۳ - چنانچه بعد از فراغت از تحصيل، قصد استفاده و هرگونه بهره‌برداري اعم از چاپ کتاب،
ثبت اختراع و ... از اين پايان نامه داشته باشم، از حوزه معاونت پژوهشي واحد مجوزهاي
مربوطه را اخذ نمايم.

۴ - چنانچه در هر مقطع زماني خلاف موارد فوق ثابت شود، عواقب ناشي از آن را بپذيرم و
واحد دانشگاهي مجاز است با اينجان‌ب مطابق ضوابط و مقررات رفتار نموده و در صورت
ابطال مدرک تحصيليام هيچگونه ادعائي نخواهم داشت.

نام و نام خانوادگي: عظيم نادري
تاريخ و امضاء

بسمه تعالی

در تاریخ: ۱۳۹۱/۰۳/۱۱

دانشجو کارشناسی ارشد آقای عظیم نادری 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: ۱۰۱۲۰۹۱۴۹۰۲۱۵	

عنوان پایان نامه : اثر هدفمندی یارانه انرژی بر متغیرهای کلان اقتصادی

نام و نام خانوادگی دانشجو: عظیم نادری شماره دانشجویی: ۸۷۰۸۵۰۲۶۶۰۰ رشته تحصیلی: علوم اقتصادی-علوم اقتصادی	تاریخ شروع پایان نامه: ۹۰/۰۳/۲۱ تاریخ اتمام پایان نامه: ۹۱/۰۳/۱۱
--	---

استاد راهنما: سرکار خانم دکتر منیژه هادی نژاد دارسرا
استاد مشاور: آقای دکتر تیمور محمدی

آدرس و شماره تلفن: تهران-پیچ شمیران-دانشکده اقتصاد و حسابداری واحد تهران مرکز

چکیده پایان نامه (شامل خلاصه، اهداف، روش‌های اجرا و نتایج به دست آمده):
هدفمندی یارانه‌های انرژی و تاثیر آن بر متغیرهای کلان اقتصادی از مباحث مهم اقتصادی میباشد. پس از گذشت چند ماه از هدفمند کردن یارانه‌ها وزارتخانه‌هایی همچون وزارت تعاون، کار و رفاه اجتماعی-صنعت، معدن و تجارت را بیشتر از وزارتخانه‌های دیگر مشغول خود کرده است. لذا یک مساله پیش روی دولت ارزیابی آثار سیاست‌های هدفمندی یارانه‌ها بر بیکاری، اشتغال و رشد میباشد که این مساله پژوهش فعلی را ضروری می‌سازد. متغیرهای سطح قیمت، شاخصی از بهای انرژی، رشد تولید ناخالص داخلی (G)، حجم پول (M) را در مدل وارد نموده‌ایم. برای ایجاد مانایی از دوبر تفاضل M و P استفاده شده است. تفاضل مرتبه اول، شاخص بهای انرژی و نیز نرخ رشد به شکل سطح وارد مدل گردید. نتایج دلالت بر آن دارند که شوک در قیمت انرژی ناشی از آزاد سازی قیمت انرژی در اثر هدفمند کردن یارانه‌ها لااقل طی ۳ دوره باعث افزایش سطح قیمت‌ها می‌شود. همچنی طی دو سال اولیه کاهش شدید در رشد برقرار می‌گردد. این نتایج از الگوی توابع واکنش ضریب‌های IRF حاصل شده است. چون بیکاری طبق منحنی فیلیپس رابطه عکس با رشد دارد انتظار داریم طی دو سال مذکور بیکاری افزایش یابد. همچنین رابطه علیت گلنجر بیان می‌دارد تورم به شدت تحت تاثیر قیمت انرژی است اما رشد و بیکاری تاثیر کمتری از قیمت انرژی و شوک مربوطه می‌گیرند.

نظر استاد راهنما برای چاپ در پژوهش نامه دانشگاه مناسب است تاریخ و امضاء:
 مناسب نیست

۱ پیشگفتار	۱
۳ فصل اول: کلیات تحقیق	۳
۴ ۱-۱- مقدمه	۴
۸ ۱-۲- بیان مسأله تحقیق	۸
۹ ۱-۳- اهمیت موضوع تحقیق و انگیزه انتخاب آن	۹
۹ ۱-۴- هدفهای تحقیق	۹
۱۰ ۱-۵- سوالات یا فرضیه های تحقیق	۱۰
۱۰ ۱-۶- چهارچوب نظری تحقیق	۱۰
۱۱ ۱-۷- مدل تحقیق	۱۱
۱۱ ۱-۸- روش تحقیق	۱۱
۱۲ ۱-۹- جامعه آماری و حجم آن	۱۲
۱۲ ۱-۱۰- برآورد حجم نمونه و روش نمونه گیری (در صورت نمونه گیری)	۱۲
۱۲ ۱-۱۱- روش گرد آوری اطلاعات	۱۲
۱۲ ۱-۱۲- روش تجزیه و تحلیل اطلاعات	۱۲
۱۲ ۱-۱۳- متغیرها و واژه های کلیدی	۱۲
۱۳ فصل دوم: مبانی نظری و ادبیات موضوع	۱۳
۱۴ ۲-۱- مقدمه	۱۴
۱۵ ۲-۲- مبانی نظری	۱۵
۱۵ ۲-۲-۱- تورم	۱۵
۱۶ ۲-۲-۲- نظریه های تورم	۱۶
۱۶ ۲-۲-۲-۱- مکتب کلاسیک	۱۶
۱۶ ۲-۲-۲-۲- معادله مبادلاتی فیشر	۱۶
۱۷ ۲-۲-۲-۲- روش موجودی نقدی کمبریج	۱۷
۱۸ ۲-۲-۲-۲- نظریه جدید مقداری پول (پولین)	۱۸
۲۰ ۲-۲-۲-۳- مکتب کینز و تورم	۲۰
۲۰ ۲-۲-۲-۴- نظریه فشار هزینه	۲۰
۲۱ ۲-۲-۲-۵- نظریه ساختار گرایان	۲۱
۲۳ ۲-۲-۲-۶- نظریه های دوره های تجاری واقعی	۲۳
۲۳ ۲-۲-۲-۷- نظریه تورم روانی	۲۳
۲۴ ۲-۲-۲-۸- نظریه تورم وارداتی	۲۴
۲۴ ۲-۳- انواع تورم	۲۴
۲۴ ۲-۳-۱- طبقه بندی براساس منشأ ایجاد تورم	۲۴
۲۴ ۲-۳-۱-۱- تورم ناشی از فزونی تقاضا	۲۴
۲۵ ۲-۳-۱-۲- سطح دستمزد و بهره وری	۲۵
۲۵ ۲-۳-۱-۳- فشار سود	۲۵
۲۵ ۲-۳-۱-۴- تورم وارداتی	۲۵
۲۵ ۲-۴- رشد اقتصادی	۲۵
۲۷ ۲-۴-۱- مبانی نظری رابطه بین رشد اقتصادی و حامل های انرژی	۲۷
۲۹ ۲-۴-۲- پیشینه مطالعات تحقیقاتی در زمینه رشد اقتصادی	۲۹

۲۹	۱-۲-۴-۲- مطالعات انجام شده در زمینه رشد اقتصادی در خارج از کشور
۳۰	۲-۲-۴-۲- مطالعات انجام شده در زمینه رشد اقتصادی در ایران
۳۲	۲-۵-۱- بیکاری
۳۲	۲-۵-۱- سابقه ی تاریخی منحنی فیلیپس
۳۴	۲-۵-۲- مطالعات انجام شده در زمینه نرخ بیکاری در داخل کشور
۳۵	۲-۵-۳- مطالعات انجام شده در زمینه نرخ بیکاری در خارج از کشور
۳۶	۲-۵-۴- رویکرد اقتصاد کلان و بازار نیروی کار
۳۸	۲-۶-۱- ادبیات موضوع (سایر کشورها)
۳۸	۲-۶-۱- تاریخچه یارانه در جهان
۳۸	۲-۶-۲- مروری بر مطالعات انجام شده در خارج از کشور
۴۲	۲-۷-۱- ادبیات موضوع (داخل کشور)
۴۲	۲-۷-۱- تاریخچه یارانه در ایران
۴۵	۲-۷-۲- مروری بر مطالعات انجام شده در داخل کشور
۴۸	۲-۸- نتیجه گیری
۴۹	فصل سوم: تحلیل هدفمندی یارانه ها در ایران و چند کشور منتخب
۵۰	۳-۱- مقدمه
۵۱	۳-۲- یارانه ها
۵۵	۳-۳- فرآورده های نفتی
۵۶	۳-۴- برق
۵۷	۳-۵- اثرات پرداخت یارانه انرژی
۵۷	۳-۵-۱- آثار اقتصادی
۵۷	۳-۵-۲- آثار اجتماعی
۵۸	۳-۵-۳- آثار زیست محیطی
۶۰	۳-۶- تجربیات سایر کشورها در زمینه یارانه حامل های انرژی
۶۲	۳-۶-۱- لهستان
۶۲	۳-۶-۲- بلغارستان
۶۳	۳-۶-۳- اندونزی
۶۴	۳-۶-۴- چین
۶۵	۳-۶-۵- ترکیه
۶۶	۳-۷- اصلاح یارانه ها
۶۷	۳-۸- نتیجه گیری
۶۹	فصل چهارم: برآورد مدل تحقیق
۷۰	۴-۱- مقدمه
۷۱	۴-۲- اقتصاد سنجی سری های زمانی و مفاهیم کلیدی
۷۴	۴-۳- مدل های معادلات همزمان
۷۵	۴-۴- همجمعی و الگوی تصحیح خطا (ECM)
۷۶	۴-۵- معرفی متغیر های مدل
۷۷	۴-۶- برآورد تجربی مدل
۷۷	۴-۷- آزمون ایستایی متغیر ها
۷۸	۴-۸- تعیین طول وقفه بهینه

۷۹	۹-۴- توابع عكس العمل آنی
۸۳	۱۰-۴- جمع بندي فصل
۸۴	فصل پنجم: نتیجه گیری و پیشنهادات
۸۵	۱-۵- مقدمه
۸۶	۲-۵- نتایج تحقیق
۸۷	۳-۵- پیشنهادات
۸۸	۴-۵- پیشنهاد برای تحقیقات آتی
۸۹	فهرست منابع
۹۴	ضمیمه
۱۰۳	چکیده

جدول (۱-۳) یارانه حامله‌های انرژی در سال ۱۳۸۸ به تفکیک حامل‌ها و بخشهای مصرف‌کننده ^۱	۵۳
جدول (۲-۳) قیمت واقعی حامله‌های انرژی بر اساس شاخص قیمت خرده‌فروشی (CPI) (سال پایه ۱۳۸۳).....	۵۵
جدول (۳-۳) اثر حذف یارانه مصرفی انرژی در کشورهای منتخب (۱۹۹۹).....	۵۹
جدول (۱-۴): تعیین وقفه بهینه.....	۷۸
جدول (۲-۴): جدول واریانس.....	۸۰
جدول (۳-۴): مقایسه دوره‌های کوتاه مدت، میان مدت و بلند مدت.....	۸۲
جدول آزمون مانایی ریشه واحد.....	۹۵
جدول علیت گلنجر.....	۹۸
جدول تخمین مدل.....	۱۰۰

نمودار (۱-۲) بررسی اثرات ناشی از تعیین سقف دستمزد بر تولید، اشتغال و سطح قیمت ها.....	۳۷
نمودار توابع واکنش آنی.....	۹۸
نمودار توابع واکنش.....	۱۰۱

پیشگفتار

پایان نامه مذکور از پنج فصل تشکیل شده است:

فصل اول به کلیات موضوع، سؤالات و فرضیات تحقیق پرداخته است. که سؤالات و فرضیه‌های تحقیق به شرح زیرند:

سؤالات تحقیق:

۱- آیا هدفمندی یارانه‌ها بر بیکاری تأثیر مثبت و معنادار دارد؟

۲- آیا هدفمندی یارانه‌ها باعث افزایش تورم بطور معنادار می‌گردد؟

فرضیه‌های تحقیق:

۱- هدفمند کردن یارانه‌ها اثر مثبت معنادار بر بیکاری دارد.

۲- هدفمند کردن یارانه‌ها اثر مثبت معنادار بر تورم دارد.

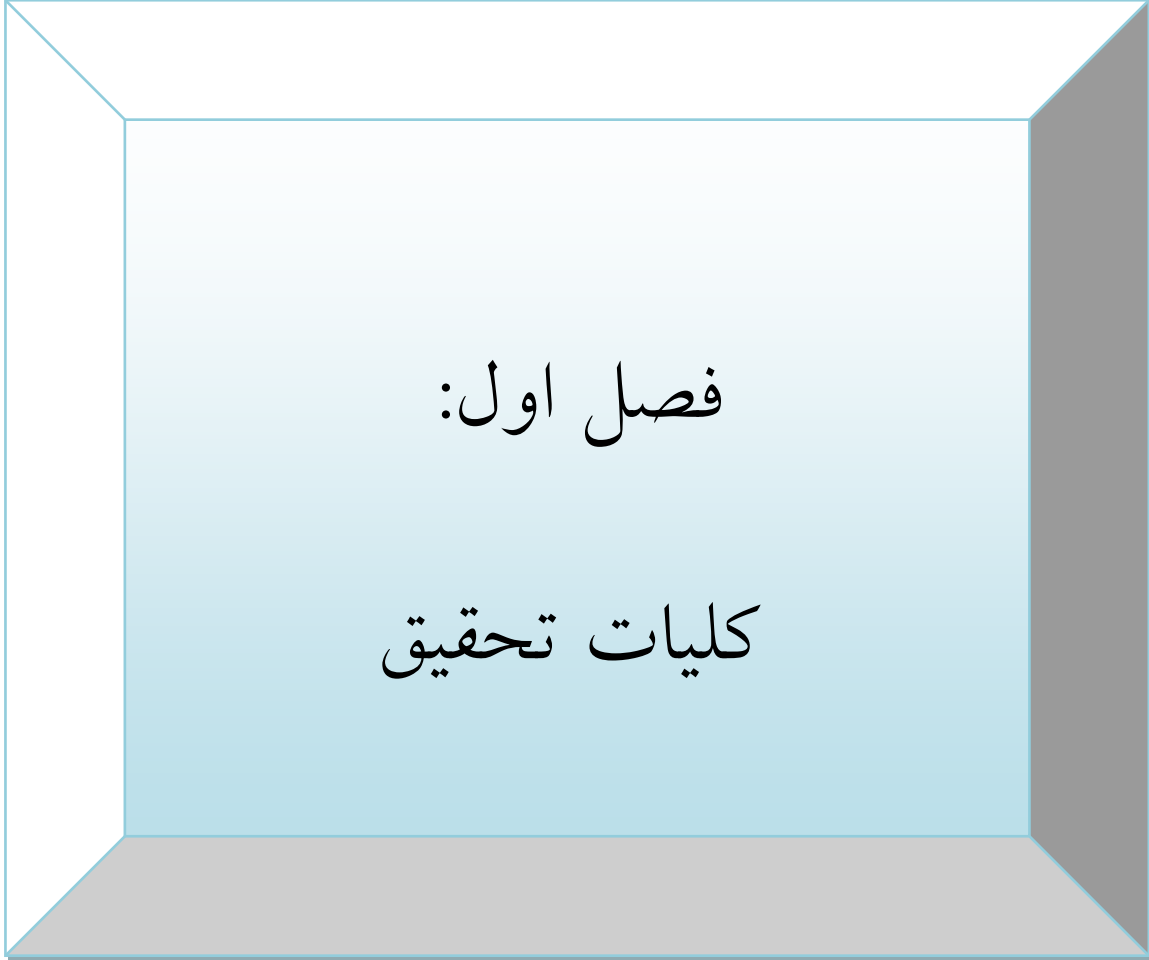
فصل دوم به بررسی مبانی نظری موضوع، نحوه ارتباط متغیرهای وارد شده در مدل با متغیر شاخص قیمت‌های حامل انرژی پرداخته است و دیدگاه تئوریک بر این باور است که ارتباط بین تولید ناخالص داخلی، حجم نقدینگی و تورم با شاخص قیمت‌های حامل انرژی مثبت است در ادامه به بررسی تجربه سایر کشورها در زمینه هدفمند کردن یارانه‌ها پرداخته‌ایم. فصل سوم به بررسی پیشینه تحقیق و تحقیقات انجام شده در داخل و خارج کشور پرداخته شده است.

فصل چهارم به بررسی مبانی نظری مدل روش خودرگرسیون برداری و علت انتخاب این روش برای تخمین متغیرهای فوق پرداخته است. علت انتخاب این روش آن است که ، در این پایان نامه هدف بررسی شوک ناشی از هدفمند نمودن یارانه‌ها بر سطح تعادلی متغیرها در سطح کلان است در نتیجه به علت وجود داشتن ماهیت شوک در مدل مذکور، از روش خود رگرسیون برداری استفاده گردیده است.

فصل پنجم به نتیجه‌گیری و ارائه پیشنهادات ناشی از تخمین مدل پرداخته است. نتایج حاصل از تخمین مدل به شرح زیر است:

متغیرهای سطح قیمت، شاخصی از بهای انرژی، رشد تولید ناخالص داخلی (G)، حجم پول (M) را در مدل وارد نموده‌ایم. برای ایجاد مانایی از دوبار تفاضل M و P استفاده شده است. تفاضل مرتبه اول، شاخص بهای انرژی و نیز نرخ رشد به شکل سطح وارد مدل گردید. نتایج دلالت بر آن دارند که شوک در قیمت انرژی ناشی از آزاد سازی قیمت انرژی در اثر هدفمند

کردن یارانه‌ها لا اقل طی ۳ دوره باعث افزایش سطح قیمت‌ها می‌شود. همچنین طی دو سال اولیه کاهش شدید در رشد برقرار می‌گردد. این نتایج از الگوی توابع واکنش ضریب‌های IRF حاصل شده است. چون بیکاری طبق منحنی فیلیپس رابطه عکس با رشد دارد انتظار داریم طی دو سال مذکور بیکاری افزایش یابد. همچنین رابطه علیت گلنجر بیان می‌دارد تورم به شدت تحت تأثیر قیمت انرژی است اما رشد و بیکاری تأثیر کم‌تری از قیمت انرژی و شوک مربوطه می‌گیرد. با توجه به نتایج تحقیق هر دو فرضیه مورد بررسی مورد تأیید قرار می‌گیرند. یعنی هدفمند کردن یارانه‌ها بر روی بیکاری در کوتاه مدت تأثیر مثبت و در بلند مدت دارای تأثیر منفی است در نتیجه فرضیه اول در کوتاه مدت تأیید و در بلند مدت رد می‌شود و فرضیه دوم که بیان می‌دارد هدفمند کردن یارانه‌ها اثر مثبت معنادار بر تورم دارد مورد تأیید قرار می‌گیرد.



فصل اول:

کلیات تحقیق

۱-۱- مقدمه

اجرای طرح هدفمند کردن یارانه‌ها و اصلاح قیمت حامل‌های انرژی، با توجه به اثرگذاری بر متغیرهای اقتصاد کلان، مصرف بخش خصوصی و تولید زیر بخش‌های صنعت از حساسیت بالایی در اقتصاد کشور برخوردار است. افزایش قیمت حامل‌های انرژی مدت‌هاست که در اقتصاد ایران محل بحث و منازعه بوده است و با توجه به اهمیت موضوع و تأثیر آن بر اقتصاد و رفاه جامعه، مطالعات و بررسی‌های بیشتر و جامع‌تر در این حوزه ضروری به نظر می‌رسد. قیمت‌گذاری حامل‌های انرژی در اقتصاد ایران به وسیله‌ی دولت انجام شده و همواره پایین‌تر از قیمت جهانی بوده است؛ به نظر می‌رسد ادامه این شیوه برای اقتصاد ایران سخت و پرهزینه شده است و به همین دلیل، دولت و نهادهای سیاست‌گذاری سعی در اصلاح این شیوه‌ی قیمت‌گذاری حامل‌های انرژی دارند. طی سه دهه‌ی پس از انقلاب، اقتصاد ایران شاهد تورم‌های بالایی بوده است. اما، در این مدت قیمت انرژی متناسب با این تورم افزایش نیافته و به طور مداوم فاصله‌ی قیمت انرژی از بهای تمام شده‌ی آن بیشتر شده است؛ بنابراین، میزان یارانه‌ها رشد صعودی داشته است. کاهش قیمت‌های واقعی انرژی، افزایش مصرف بیش از حد انرژی در ایران را سبب شده است، برخی از اقتصاددانان یارانه را به صورت تفاوت قیمت تمام شده یا حداکثر قیمت خرید یک کالا یا خدمت با قیمت فروش آن از سوی دولت تعریف می‌کنند. (سبحانی، حسن ۱۳۸۵) در این تعریف چیزی به نام هزینه‌ی فرصت یا واژه‌هایی دیگر از این قبیل وجود ندارد. این گروه معتقدند که آنچه در اقتصاد ایران به عنوان یارانه مطرح است، به طور مشخص مبالغی است که دولت در بودجه‌های سنواتی خود برای تولید برخی کالاها یا تأمین برخی از اقلام یا کالاهای دیگر داخل و یا خارج از کشور، برای مصرف‌کننده یا تسهیل خدمات بانکی از حیث تسهیلات به مردم پرداخت می‌کند. بر مبنای این تعریف، در اقتصاد ایران حامل‌های انرژی در کشور یارانه ندارد. گروهی دیگر از اقتصاددانان با این تعریف درباره انرژی و اینکه در ایران یارانه انرژی نداریم، به شدت مخالف بوده و معتقدند که باید هزینه‌ی فرصت درباره انرژی را لحاظ کرد و این گونه تحلیل‌ها درباره عدم پرداخت یارانه به حامل‌های انرژی را خط بطلانی بر اصل مهم اقتصادی؛ یعنی هزینه‌ی فرصت می‌دانند. (کميجانی، اکبر ۱۳۸۵)

طی ۳۰ سال گذشته همواره مباحث مربوط به افزایش قیمت حامل‌های انرژی (واقعی کردن قیمت‌ها) از جمله موضوعات مهم و پر حاشیه اقتصاد ایران بوده است. این مساله در مراحل مختلف تا مرز تصمیم‌گیری‌های نهایی جلو رفته و هر بار به دلیلی متوقف شده یا ناقص به اجرا درآمده است. اولین بار در سال‌های ابتدایی دهه ۶۰ افزایش قیمت انرژی صورت گرفت که بعدها به صورت یارانه‌هایی به روستاییان پرداخت شد و توجه آن روی بعد باز توزیعی بود. سپس در برنامه اول توسعه در سال ۱۳۶۸ اصلاح قیمت انرژی گنجانده شد و در مجلس به تصویب رسید، اما در اجرا متوقف شد. در برنامه دوم توسعه، دولت تمایل به اصلاح قیمت انرژی داشت، اما مجلس چهارم با موضوع مخالفت کرد. همچنین در برنامه سوم توسعه دولت در ماه ۱۱۷ اصلاح قیمت انرژی را گنجانده که پس از بحث‌های چالشی با این برنامه در مجلس پنجم مخالفت شد و نهایتاً حذف گردید. در برنامه چهارم نیز موضوع اصلاح قیمت انرژی و اصلاح رابطه مالی دولت و شرکت نفت مورد توجه قرار گرفت که به تصویب مجلس و تأیید شورای نگهبان رسید، اما در مجلس هفتم، حذف و نهایتاً در بودجه ۸۴ تثبیت قیمت انرژی به تصویب رسید.

این در حالی بود که در سال ۸۴ قیمت جهانی نفت افزایش یافته بود و روندی که دولت در مورد قیمت حامل‌های انرژی در پیش گرفت، متفاوت از روند بازار جهانی انرژی بود و این امر باعث شد که فاصله قیمت‌های داخلی و جهانی افزایش یابد. با توجه به دستور کار قرار گرفتن موضوع اصلاح قیمت‌ها از دو سال پیش تا کنون، سال ۸۹ در جایی قرار گرفتیم که قانون (هدفمند کردن یارانه‌ها) تصویب شده و برای اجرا در دست دولت قرار گرفت و قاعدتاً هماهنگ کردن قیمت انرژی با قیمت‌های بین‌المللی تحول بزرگی در اقتصاد ما خواهد بود و آثار و پیامدهای زیادی بر جای خواهد گذاشت. از آنجا که انرژی در ایران علاوه بر نقش ماده مهم در تولید و نیز کالا مصرفی برای خانوار، آثار مهمی روی تراز پرداخت‌ها و بودجه دولت دارد، بنابراین موضوع قیمت حامل‌های انرژی و تغییرات آن، حداقل در چهار مولفه از اهمیت برخوردار است:

مولفه اول در سطح خرد و بنگاه‌های اقتصادی است؛ چه بنگاه‌های تولیدکننده انرژی و چه مصرف‌کننده و چه نهادهای مالی که تجهیز منابع می‌کنند. همچنین موضوع اصلاح قیمت در سطح خرد برای خانوارها هم عنصر مهمی است. هر چند که محاسبات اولیه نشان می‌دهد سهم هزینه‌های انرژی در سبد خانوارها بین ۱ تا ۴ درصد است و چنانچه اصلاح شود می‌تواند به سمتی حرکت کند که در کشورهای دیگر هزینه‌های انرژی در مصرف خانوار دارد. از سوی دیگر، در بعد اقتصاد کلان، اصلاح قیمت حامل‌ها روی کسری بودجه، تراز پرداخت‌ها، حجم نقدینگی، تورم، بیکاری و رشد و سایر متغیرهای کلان اثر خواهد گذاشت.

مقاومت در برابر افزایش قیمت انرژی و هماهنگی آن با قیمت‌های بین‌المللی از مشکلات همیشگی در سیستم تصمیم‌گیری کشور است. برای شروع تحلیل آثار افزایش قیمت‌ها بر اقتصاد، نمی‌توان از پاسخ به این سوال که «چرا قیمت انرژی در اقتصاد ایران طی سال‌های گذشته همواره روند متمایزی از قیمت‌های بین‌المللی طی کرده است» غفلت کنیم. اینکه قیمت انرژی در کشور با قیمت‌های جهانی فاصله متفاوتی دارد یک اتفاق تصادفی نیست، بلکه برآمده از خواست و اراده‌ای در سیاست‌گذاری‌ها بوده است. تمایل جدی نسبت به افزایش بودجه در اقتصاد ایران همواره وجود داشته، بنابراین مخارج دولت در واکنش به تلقی از نقش دولت در جهت جبران با شدت زیادی افزایش یافته است. همچنین بررسی‌ها نشان می‌دهد وقتی به جمعیت توجه نمی‌کنیم یکی از متغیرهایی که بیش از تورم در کشور ما افزایش داشته، بودجه دولت بوده است. افزایش مخارج، دولت‌ها را به سمت استفاده از منابع بانک مرکزی سوق داده و این امر به افزایش پایه پولی در اقتصاد ایران منجر شده است. همچنین بررسی‌ها نشان می‌دهد تا سال‌های ۱۳۷۹ اصلی‌ترین عنصر افزایش پایه پولی، استقرار دولت از بانک مرکزی بوده است. از سوی دیگر پس از آن که قیمت نفت افزایش یافته، افزایش ذخایر بانک مرکزی نیز عامل اصلی افزایش پایه پولی در اقتصاد بوده که در واقع یک جابجایی از استقرار دولت از بانک مرکزی به سمت افزایش ذخایر بانک مرکزی بوده است.

همچنین بانک مرکزی در سال‌های اخیر از منابع خود به تولید کمک کرده و این باعث شده، بدهی بنگاه‌ها به بانک مرکزی افزایش یابد. با در نظر گرفتن رابطه بلند مدت میان تورم و نقدینگی، حجم نقدینگی در اقتصاد در نتیجه رفتارهای مالی دولت‌ها، به شدت افزایش یافته و در نتیجه به اقتصادی تبدیل شده‌ایم که همواره دارای یک تورم مزمن دورقمی هستیم. باید توجه داشت که اشتغال تابعی مستقیم از تولید است، اگر تولید افزایش یابد، اشتغال نیز افزایش خواهد یافت و در مقابل کاهش تولید به کاهش اشتغال خواهد انجامید؛ بنابراین بررسی پیامدهای طرح بر تولید، به طور طبیعی اثرات آن بر اشتغال را نیز آشکار خواهد ساخت. تفکیک پیامدهای طرح هدفمندی یارانه‌ها بر تولید و اشتغال به دو دوره کوتاه‌مدت و بلندمدت نیز یک نکته کلیدی است. مهم‌ترین مزیت اجرای قانون هدفمند کردن یارانه‌ها که موجب شده اقتصاددانان زیادی از این طرح حمایت نمایند این است که حذف یارانه‌های غیرمستقیم در بازار انرژی، می‌تواند موجب شفافیت بیشتر و واقعی شدن قیمت‌های نسبی در بازار و در نتیجه بهبود خاصیت علامت‌دهی قیمت‌ها در تخصیص منابع در اقتصاد کشور شود. البته این مزیت اثرات خود را در بلندمدت آشکار خواهد ساخت. بر اساس مبانی علم اقتصاد، قیمت‌های نسبی در بازار آزاد، آشکارکننده فرصت‌های کسب سود و رفع‌کننده کمبودها و مازادها در بازار است. در بازار هر یک از کالاها، خدمات و دارایی‌ها، اگر مازاد عرضه‌ای وجود داشته باشد، قیمت‌ها شروع به کاهش می‌کند به نحوی که از یک طرف با کاهش قیمت و در نتیجه کاهش سودآوری

منابع تولید از آن بازار خارج شده و عرضه کاهش می‌یابد و از طرف دیگر با کاهش قیمت مقدار تقاضای آن کالا، افزایش می‌یابد. در نتیجه کاهش قیمت موجب می‌شود تا با کاهش عرضه و افزایش تقاضا، مازاد عرضه در آن بازار حذف شده و آن بازار خاص به تعادل برسد. به همین ترتیب در یک بازار خاص، اگر کمبود عرضه‌ای وجود داشته باشد، قیمت‌ها شروع به افزایش می‌کند به نحوی که از یک طرف با افزایش قیمت و در نتیجه افزایش سودآوری، منابع تولید به آن بازار وارد شده و عرضه افزایش می‌یابد و از طرف دیگر با افزایش قیمت، مقدار تقاضای آن کالا، کاهش می‌یابد، در نتیجه افزایش عرضه و کاهش تقاضا، کمبود عرضه در آن بازار حذف شده و آن بازار خاص به تعادل می‌رسد.

آنچه موجب نگرانی در حوزه تولید است، کاهش تولید در کوتاهمدت است. در واقع افزایش قیمت انرژی به عنوان یک نهاده تولید را می‌توان یک شوک منفی طرف عرضه اقتصاد ارزیابی نمود. افزایش قیمت نهاده انرژی، به طور مستقیم هزینه تولیدکنندگان داخلی (البته به نسبت میزان انرژی بری هر صنعت) را افزایش می‌دهد. این افزایش ناگهانی هزینه‌ها، حاشیه سود بنگاه‌ها را در کوتاهمدت با توجه به میزان انرژی بری آنها به شدت کاهش خواهد داد. به علاوه این افزایش هزینه‌ها در کوتاهمدت، توان رقابتی تولیدکنندگان داخلی را در برابر رقبای خارجی هم در بازار داخلی (در برابر کالاهای وارداتی) و هم در بازارهای خارجی (برای صادرکنندگان)، تضعیف خواهد نمود. در نتیجه در کوتاهمدت، اجرای طرح هدفمندی یارانه‌ها می‌تواند موجب تضعیف و کاهش تولید صنایع داخلی و بالطبع کاهش اشتغال شود. یکی دیگر از عوامل افزایش تورم در کشورمان، ثابت نگه داشتن قیمت انرژی برای جلوگیری از کاهش تولید داخلی است. دولت می‌خواهد از طریق پرداخت انرژی ارزان به ساختار هزینه‌های بنگاه‌ها کمک کند. بنابراین زمانی که تورم بالا است و قیمت انرژی کاهش می‌یابد، طبیعی است که بنگاه‌ها در فشار هستند از انرژی ارزان استفاده می‌کنند و لذا صنایع ما بسیار انرژی بر شده است. چنانچه صنایع تولید خودرو را هم به عنوان صنایعی که محصولاتشان انرژی بر هستند به آن‌ها اضافه کنیم، این صنایع حدود ۷۰ درصد از انرژی صنعت را مصرف می‌کنند. بنابراین صنعت ما به سمت هر چه انرژی برتر شدن حرکت می‌کند، که این یک واکنش منطقی به استفاده ارزان از یک نهاد است. مصرف انرژی صنعت لزوماً به مفهوم تکنولوژی انرژی‌بر بودن نیست، فرسودگی ماشین‌آلات صنایع باعث مصرف انرژی بیشتری شده است.

چنانچه ساختار صنعت را بر حسب نوع مالکیت و اندازه بنگاه‌ها تفکیک کنیم، می‌بینیم که عمده انرژی صنعت ما را بنگاه‌های اقتصادی دولتی مصرف می‌کنند لذا انرژی‌بری دولت بیش از بخش خصوصی بوده است. انرژی ارزان خانوارها را نیز به سوی مصرف بیشتر سوق می‌دهد. به عنوان یک شاخص درصد خانوارهای دارای اتومبیل در کشور طی این سال‌ها بیشتر شده است. مجموعه شرایط فوق باعث

گردیده مصرف انرژی در کشور ما در مقایسه با کشورهای خاورمیانه بالاتر بوده و بالاترین یارانه انرژی را هم پرداخت کنیم (بنابراین در ایران سرانه یارانه انرژی بالایی پرداخت می‌شود). از طرف دیگر هر چه بیشتر در داخل انرژی مصرف شود، مقدار صادرات کاهش، منابع دولت و تراز پرداخت‌ها کاهش می‌یابد.

۱-۲- بیان مسأله تحقیق

با توجه به هدفمندی یارانه‌های انرژی و تاثیر آن بر متغیرهای کلان اقتصادی که از مباحث مهم اقتصادی بوده و پس از گذشت چندین ماه از هدفمند کردن یارانه‌ها وزارتخانه‌هایی همچون وزارت تعاون، کار و رفاه اجتماعی، امور اقتصادی و دارایی، صنعت، معدن و تجارت را بیشتر از وزارتخانه‌های دیگر مشغول خود کرده است. لذا یک مسأله پیش روی دولت ارزیابی آثار سیاست‌های هدفمندی یارانه‌ها بر بیکاری، اشتغال و رشد اقتصادی می‌باشد که این مسأله پژوهش فعلی را ضروری می‌سازد. در ماه‌های اخیر، هدفمندی یارانه‌های انرژی و تاثیر آن بر متغیرهای کلان اقتصادی از بحث برانگیزترین مباحث اقتصادی بوده است. مهم‌ترین قسمت این طرح، اصلاح قیمت حامل‌های انرژی به تدریج تا پایان برنامه پنجم می‌باشد. شاید بتوان گفت که در کشور ما از میان متغیرهای اقتصادی، سطح عمومی قیمت‌ها (تورم)، بیکاری، رشد اقتصادی و چگونگی روند این متغیرهای کلان اقتصادی بیشترین توجه را به خود جلب می‌کنند.

بنابراین، افزایش قیمت انرژی و چگونگی اثرگذاری آن بر سطح عمومی قیمت‌ها اهمیت زیادی دارد. در ایران رشد نقدینگی، افزایش هزینه‌های تولیدی و تورم انتظاری از علت‌های افزایش سطح عمومی قیمت‌ها و در نتیجه تورم به شمار می‌رود. آزادسازی قیمت انرژی و به خصوص حامل‌های انرژی، تورم ناشی از فشار هزینه و افزایش تورم انتظاری را در پی دارد. بیشترین حساسیت عموم مردم کشور ما در پیش‌بینی سطح عمومی قیمت‌ها و در نتیجه تورم انتظاری، تغییرات قیمتی است. به راستی انرژی چند درصد از هزینه‌های خانوارها را شامل می‌شود، آیا بخش عمده‌ای از تورم انتظاری ناشی از آزادسازی قیمت‌ها، کاذب نیست؟ افزایش قیمت حامل‌های انرژی به چه میزان بر تورم کشور ما تاثیر می‌گذارد؟ و در نهایت این سوال مطرح می‌شود که چگونه می‌توان تاثیر تورم‌زای این طرح را به کمترین میزان رساند؟

در بیشتر صنایع، انرژی با درصدهای مختلف به کار برده می‌شود. بنابراین با قطع شدن یارانه انرژی بهای تولیدی کالاهای مختلف افزایش می‌یابد. در نتیجه صنایع تلاش می‌کنند این افزایش قیمت را با مصرف بهینه سوخت و ارتقای بهره‌وری جبران کنند.

با اجرای طرح هدفمند کردن یارانه‌ها قیمت بنزین و سایر فرآورده‌های نفتی مستقیماً از قیمت جهانی نفت تأثیر می‌پذیرد. از اوایل دهه ۱۹۷۰ و با افزایش قیمت نفت، جهان شاهد چند شوک نفتی بوده است.