

سنة الفجر



**دانشگاه ارومیه**

**دانشکده اقتصاد و مدیریت**

**گروه اقتصاد**

**پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته علوم اقتصادی**

**عنوان:**

**بررسی تأثیر درآمدهای نفتی بر شاخص حکمرانی خوب در کشورهای منتخب عضو اوپک**

**اساتید راهنما:**

**دکتر کیومرث شهبازی**

**دکتر سید جمال‌الدین محسنی زنوزی**

**اساتید داور:**

**دکتر سلیمان فیضی**

**دکتر صمد حکمتی فرید**

**تنظیم و نگارش:**

**روناک پرناک**

**مهر ماه ۱۳۹۳**

**حق چاپ برای دانشگاه ارومیه محفوظ است**

تقدیم به

مقدس ترین واژه در لغت نامه دلم.....

پدرم، مهربانی مشق، بردبار و حامی

مادر مهربانم که زندگیم را دیون مهر و عطا قش می دانم

برادر و خواهرم، همراهن، همسنگی و پشتیبانهای زندگیم

اول دقتر به نام اینردانا صلح و پرورکاری و توانا

شکر شایان نثار پروردگار منان که توفیق را رفیق را هم ساخت تا این پایان نامه را به پایان برسانم. از زحمات تمامی عزیزانی که در به انجام رساندن این مهم یاری ام نمودند و همواره مرا مورد لطف و محبت خود قرار داده اند کمال تشکر و قدردانی را دارم.

خانواده عزیزم:

پدر و مادر عزیزتر از جانم، به خاطر همه تلاش های بی دریغ و محبت آمیزی که در دوران مختلف زندگی ام انجام داده اند و با مهربانی چگونه زیستن را به من آموخته اند. آنان که نفس خیرشان و دعای روح پرورشان بدرقه راهم بود. خواهر و برادر عزیزم، که وجودشان مایه دلگرمی من است.

استاد محترم و کرامی:

استاد ارجمند جناب آقای دکتر سید جمال الدین محسنی زنوزی که در کمال سعه صدر و با حسن خلق، از هیچ کجی دریغ ننموده و راهنمایی این پایان نامه را به عهده گرفتند.

استاد ارجمند جناب آقای دکتر کیومرث شهبازی که با صبر و حوصله در تمامی مراحل انجام این تحقیق، دلسوزانه مراراً مهربانی کردند.

استادیداور جناب آقایان: دکتر صدحکمتی فرید و دکتر سلیمان فیضی که بی منت زحمت مطالعه این پایان نامه را تقبل نمودند.

و تمامی استادی گرامی دانشکده اقتصاد دانشگاه ارومیه که همواره از علم سرشارشان مستفید شدم.

پروردگارا:

حسن عاقبت، سلامت و سعادت را برای همگی آنان مقدر فرما و به من کمک کن تا بتوانم ادای دین کنم و به خواسته آنان جامه عمل بپوشانم.

رونانک پرنانک

پاییز ۱۳۹۳

## چکیده

شاخص حکمرانی خوب از مهمترین عوامل رشد و توسعه کشورها محسوب می‌شود. بر خورداری کشورهای نفت خیز از درآمدهای نفتی با تأثیر بر عملکرد دولت به چالش‌هایی نظیر رشد پایین اقتصادی، فقر و فقدان پاسخگویی، فساد و عدم حاکمیت قانون منجر شده است. هدف اصلی این پژوهش بررسی تأثیر درآمدهای نفتی بر شاخص حکمرانی خوب در کشورهای عضو اوپک با استفاده از رهیافت داده‌های تابلویی طی دوره زمانی ۲۰۱۱-۱۹۹۶ است. در این پژوهش از میانگین حسابی شش مؤلفه کنترل فساد، کیفیت نهادی، کیفیت قوانین، قانون‌مداری، اعتراض و پاسخگویی و ثبات سیاسی تحت عنوان شاخص حکمرانی خوب، استفاده شده است و تأثیر درآمدهای نفتی بر تمامی مؤلفه‌ها نیز به صورت جداگانه بررسی شده است. جهت رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی اجزای اخلاص از روش FGLS استفاده گردیده است. بر اساس نتایج حاصله از تحقیق، درآمدهای نفتی اثر منفی و معنی‌داری بر شاخص حکمرانی خوب داشته است. همچنین نتایج حاکی از تأثیر منفی و معنی‌دار درآمدهای نفتی بر مؤلفه‌های دیگر شاخص حکمرانی نظیر شاخص‌های کنترل فساد، ثبات سیاسی و اعتراض و پاسخگویی می‌باشد. از طرف دیگر، درآمدهای نفتی بر روی کیفیت نهادی و کیفیت قوانین اثر منفی و روی قانون‌مداری اثر مثبت داشته اما این تأثیرات معنی‌دار نبوده است. به علاوه، اندازه دولت بیشترین تأثیر منفی را بر شاخص حکمرانی خوب داشته و بر اکثر مؤلفه‌های حکمرانی خوب نیز اثر منفی داشته است. از طرف دیگر، FDI بر شاخص حکمرانی خوب و اکثر مؤلفه‌های آن تأثیر مثبت دارد. به سبب تأثیر منفی درآمدهای نفتی بر شاخص حکمرانی خوب، هدایت و کنترل جریان درآمدهای نفتی به سمت صندوق ذخیره ارزی و صندوق پس‌انداز ملی، می‌تواند ضمن کاهش اتکای دولت به درآمدهای نفتی سبب بهبود شاخص حکمرانی خوب شود.

**واژگان کلیدی:** شاخص حکمرانی خوب، درآمدهای نفتی، اوپک، رهیافت داده‌های تابلویی

## فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول- کلیات تحقیق.....
۲	۱-۱ مقدمه .....
۳	۲-۱ تعریف مسئله و بیان اصلی تحقیق .....
۴	۳-۱ ضرورت انجام تحقیق .....
۶	۴-۱ اهداف تحقیق .....
۶	۵-۱ فرضیه‌های تحقیق .....
۷	۶-۱ تبیین متغیرهای تحقیق .....
۷	۱-۶-۱- متغیرهای مستقل .....
۷	۲-۶-۱- متغیرهای وابسته .....
۷	۷-۱ تعریف مفاهیم و متغیرها .....
۷	۱-۷-۱- اندازه دولت .....
۸	۲-۷-۱- سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی .....
۸	۳-۷-۱- حکمرانی خوب .....
۹	۴-۷-۱- داده‌های تابلویی .....
۹	۸-۱ روش انجام تحقیق .....
۹	۹-۱ جامعه و نمونه آماری .....
۹	۱۰-۱ چارچوب ساختاری فصول آتی .....
۱۰	۱۱-۱ خلاصه فصل .....
۱۱	فصل دوم- ادبیات موضوعی تحقیق.....
۱۲	گفتار اول: مبانی نظری.....
۱۲	۱-۱-۲ مقدمه .....
۱۳	۲-۱-۲ شاخص حکمرانی خوب .....

۱۳	۱-۲-۱-۲- پیدایش حکمرانی خوب
۱۴	۲-۲-۱-۲- تفاوت‌های حکمرانی خوب با سیاست‌های تعدیل
۱۴	۳-۲-۱-۲- مفهوم حکمرانی خوب
۱۸	۴-۲-۱-۲- شاخص‌های حکمرانی خوب
۲۰	۳-۱-۲- اوپک و اقتصاد نفت
۲۴	۴-۱-۲- درآمدهای نفتی و آثار اقتصادی آن
۲۴	۱-۴-۱-۲- وفور منابع طبیعی، رشد اقتصادی و کیفیت نهادی
۲۶	۲-۴-۱-۲- بیماری هلندی
۲۷	۱-۲-۴-۱-۲- بیماری هلندی در اقتصاد ایران
۲۸	۵-۱-۲- درآمد نفتی، مخارج دولت
۳۱	۱-۵-۱-۲- درآمد نفتی و اندازه دولت ( مطالعه موردی ایران)
۳۱	۶-۱-۲- تبیین‌های اقتصاد سیاسی برای بلای منابع (نحسی منابع)
۳۳	۷-۱-۲- درآمد نفتی، شاخص‌های حکمرانی خوب
۳۳	۱-۷-۱-۲- درآمد نفتی و فساد
۳۵	۲-۷-۱-۲- درآمد نفتی و دموکراسی
۳۸	۳-۷-۱-۲- درآمد نفتی و امنیت
۳۹	۴-۷-۱-۲- درآمد نفتی و کیفیت نهادی
۴۰	۸-۱-۲- اندازه دولت و فساد
۴۱	۹-۱-۲- مخارج دولتی و فساد
۴۳	۱۰-۱-۲- حکمرانی خوب و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی (FDI)
۴۴	۱-۱۰-۱-۲- روند سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در جهان و کشورهای در حال توسعه
۴۶	۱۱-۱-۲- روابط بین عناصر تشکیل دهنده شاخص حکمرانی خوب در کشورهای مواجه با نفرین منابع طبیعی
۴۸	۱۲-۱-۲- رتبه بندی ایران در مؤلفه‌های شاخص حکمرانی خوب
۴۹	۱-۲-۲- مطالعات خارجی
۵۲	۲-۲-۲- مطالعات داخلی



۵۵	..... بحث ۳-۲-۲ راجع به گفتار دوم
۵۶	..... فصل سوم- روش‌شناسی تحقیق
۵۷	..... ۱-۳ مقدمه
۵۷	..... ۲-۳ مزایای داده‌های تابلویی
۵۹	..... ۳-۳ مدل‌های رگرسیونی
۶۱	..... ۱-۳-۳ مدل اثرات ثابت
۶۳	..... ۲-۳-۳ مدل اثرات تصادفی
۶۵	..... ۴-۳ آزمون‌های مربوط به داده‌های تابلویی
۶۵	..... ۱-۴-۳ پایایی در داده‌های تابلویی
۶۶	..... ۱-۱-۴-۳ آزمون لوین، لین و چو
۶۸	..... ۲-۱-۴-۳ آزمون ایم، پسران و شین
۷۰	..... ۳-۱-۴-۳ آزمون بریتونگ
۷۱	..... ۴-۱-۴-۳ آزمون مبتنی بر باقیمانده LM (آزمون هادری)
۷۲	..... ۵-۱-۴-۳ آزمون فیشر با استفاده از آزمون دیکی فولر پیشرفته (FISHER-ADF)
۷۳	..... ۲-۴-۳ آزمون هم‌انباشتی
۷۵	..... ۳-۴-۳ آزمون معنی‌داری اثرات ثابت
۷۶	..... ۴-۴-۳ آزمون بروش پاگان
۷۶	..... ۵-۴-۳ آزمون هاسمن
۷۷	..... ۶-۴-۳ آزمون‌های تشخیصی
۷۸	..... ۱-۶-۴-۳ آزمون اوتلایرز (وجود داده‌های پرت)
۷۸	..... ۲-۶-۴-۳ همخطی
۷۹	..... ۳-۶-۴-۳ ناهمسانی واریانس
۷۹	..... ۴-۶-۴-۳ خودهمبستگی
۸۰	..... ۵-۳ خلاصه فصل

فصل چهارم- برآورد مدل و تجزیه و تحلیل یافته‌ها.....	۸۲
۱-۴ مقدمه .....	۸۲
۲-۴ ارائه مدل و توضیح متغیرها .....	۸۲
۳-۴ آمار توصیفی متغیرها .....	۸۳
۴-۴ مقایسه نموداری کشورهای منتخب عضو اوپک از نظر تک تک مؤلفه‌های شاخص حکمرانی خوب در فاصله زمانی ۲۰۱۱-۱۹۹۶: .....	۸۵
۵-۴ آزمون پایایی متغیرها .....	۸۹
۶-۴ آزمون فرضیه .....	۹۱
۴-۶-۱- آزمون فرضیه اصلی تحقیق: مدل (۴-۱) .....	۹۱
۴-۶-۱-۱- آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن .....	۹۱
۴-۶-۱-۲- آزمون‌های تشخیصی .....	۹۲
۴-۶-۱-۲-۱- آزمون اوتلایرز (وجود داده‌های پرت) .....	۹۲
۴-۶-۱-۲-۲- آزمون همخطی .....	۹۳
۴-۶-۱-۳- آزمون همسانی واریانس .....	۹۳
۴-۶-۱-۴- آزمون خودهمبستگی .....	۹۳
۴-۶-۱-۳- برآورد مدل و تفسیر ضرایب .....	۹۳
۴-۶-۲- آزمون فرضیه فرعی: مدل (۴-۲) .....	۹۴
۴-۶-۲-۱- آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن .....	۹۴
۴-۶-۲-۲- آزمون‌های تشخیصی .....	۹۵
۴-۶-۲-۲-۱- آزمون‌های تشخیصی همسانی واریانس و خودهمبستگی .....	۹۵
۴-۶-۲-۳- برآورد مدل و تفسیر ضرایب .....	۹۵
۴-۶-۳- آزمون فرضیه فرعی: مدل (۴-۳) .....	۹۶
۴-۶-۳-۱- آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن .....	۹۶
۴-۶-۳-۲- آزمون‌های تشخیصی .....	۹۶
۴-۶-۳-۱- آزمون‌های خودهمبستگی و ناهمسانی واریانس .....	۹۶
۴-۶-۳-۳- برآورد مدل و تفسیر ضرایب .....	۹۶

۹۷	..... ۴-۶-۴-آزمون فرضیه فرعی: مدل (۴-۴)
۹۷	..... ۴-۶-۴-۱-آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن
۹۸	..... ۴-۶-۴-۲-آزمون‌های تشخیصی
۹۸	..... ۴-۶-۴-۱-۲-آزمون‌های خودهمبستگی و ناهمسانی واریانس
۹۸	..... ۴-۶-۴-۳-برآورد مدل و تفسیر ضرایب
۹۹	..... ۴-۶-۵-آزمون فرضیه فرعی: مدل (۵-۴)
۹۹	..... ۴-۶-۵-۱-آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن
۹۹	..... ۴-۶-۵-۲-آزمون‌های تشخیصی
۹۹	..... ۴-۶-۵-۱-۲-آزمون‌های خودهمبستگی و ناهمسانی واریانس
۱۰۰	..... ۴-۶-۵-۳-برآورد مدل و تفسیر ضرایب
۱۰۰	..... ۴-۶-۶-آزمون فرضیه فرعی: مدل (۶-۴)
۱۰۰	..... ۴-۶-۶-۱-آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن
۱۰۱	..... ۴-۶-۶-۲-آزمون‌های تشخیصی
۱۰۱	..... ۴-۶-۶-۱-۲-آزمون‌های خودهمبستگی و ناهمسانی واریانس
۱۰۱	..... ۴-۶-۶-۳-برآورد مدل و تفسیر ضرایب
۱۰۲	..... ۴-۶-۷-آزمون فرضیه فرعی: مدل (۷-۴)
۱۰۲	..... ۴-۶-۷-۱-آزمون معنی‌داری اثرات گروه و آزمون هاسمن
۱۰۲	..... ۴-۶-۷-۲-آزمون‌های تشخیصی
۱۰۲	..... ۴-۶-۷-۲-۲-آزمون‌های خودهمبستگی و ناهمسانی واریانس
۱۰۳	..... ۴-۶-۷-۳-برآورد مدل و تفسیر ضرایب
۱۰۴	..... ۴-۷-۷-خلاصه فصل
۱۰۷	..... فصل پنجم- نتیجه‌گیری و پیشنهادات
۱۰۷	..... ۱-۵ مقدمه
۱۰۷	..... ۲-۵ خلاصه پژوهش
۱۰۷	..... ۳-۵ نتایج آزمون فرضیه‌ها

۱۰۸.....	۴-۵ نتیجه‌گیری
۱۱۲.....	۵-۵ پیشنهادات
۱۱۲.....	۱-۵-۵ - پیشنهادات سیاستی
۱۱۲.....	۲-۵-۵ - پیشنهادات پژوهشی
۱۱۳.....	منابع و مأخذ
۱۲۶.....	ضمائم

## فهرست جداول

عنوان	صفحه
جدول ۱-۲- خلاصه‌ای از شاخص‌های حکمرانی خوب از منظر بانک جهانی.....	۲۰
جدول ۲-۲- اطلاعات آماری کشورهای اوپک.....	۲۲
جدول ۳-۲- تولیدکنندگان، مصرف‌کنندگان و واردکنندگان عمده نفت جهان در سال (۲۰۰۶) (میلیون بشکه در روز).....	۲۳
جدول ۴-۲- نرخ همبستگی بین مؤلفه‌های شاخص حکمرانی خوب در کشورهای در مخاطره منابع طبیعی.....	۴۷
جدول ۵-۲- رتبه‌بندی کشورهای در مخاطره منابع طبیعی از لحاظ مؤلفه‌های شاخص حکمرانی خوب.....	۴۸
جدول ۱-۴- تحلیل توصیفی متغیر وابسته مدل.....	۸۴
جدول ۲-۴- تحلیل توصیفی متغیرهای مستقل مدل.....	۸۴
جدول ۳-۴- نتایج آزمون‌های ریشه واحد تابلویی برای گروه کشورهای منتخب عضو اوپک.....	۹۰
جدول ۴-۴- نتایج آزمون هم‌انباشتگی تابلویی کائو برای گروه کشورهای منتخب عضو اوپک.....	۹۰
جدول ۵-۴- نتایج آزمون F لیمر و بروش - پاگان و هاسمن (فرضیه اصلی).....	۹۲
جدول ۶-۴- نتایج اعتبارسنجی مقاطع.....	۹۲
جدول ۷-۴- نتایج آزمون VIF برای کل کشورهای نمونه (فرضیه اصلی).....	۹۳
جدول ۸-۴- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی بین اجزای اخلاص (فرضیه اصلی).....	۹۴
جدول ۹-۴- نتایج آزمون F لیمر و بروش - پاگان و هاسمن (فرضیه فرعی اول).....	۹۴
جدول ۱۰-۴- نتایج آزمون‌های تشخیصی (فرضیه فرعی اول).....	۹۵
جدول ۱۱-۴- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی بین اجزای اخلاص (فرضیه فرعی اول).....	۹۵

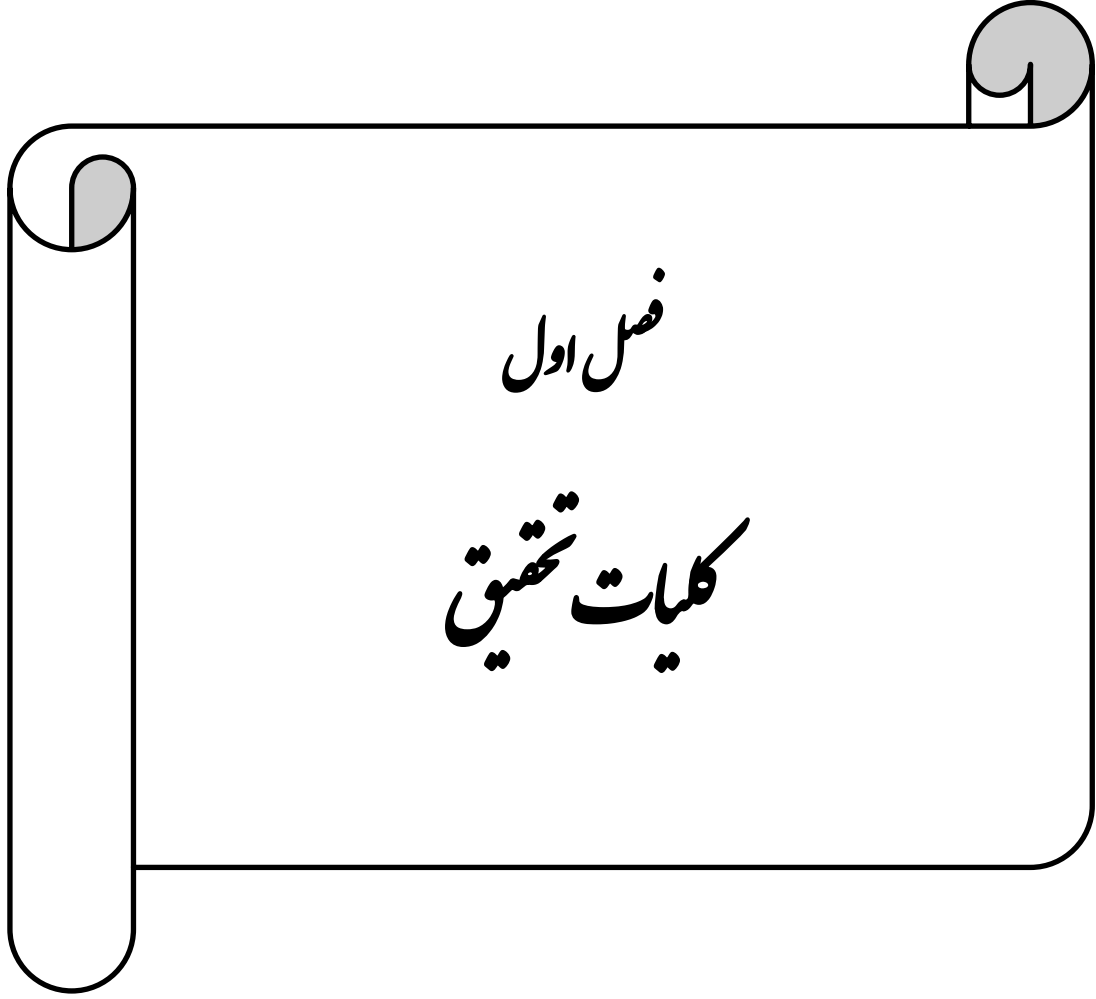
- جدول ۴-۱۲- نتایج آزمون F لیمر و بروش- پاگان و هاسمن (فرضیه فرعی دوم)..... ۹۶
- جدول ۴-۱۳- نتایج آزمون‌های تشخیصی (فرضیه فرعی دوم)..... ۹۶
- جدول ۴-۱۴- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی بین اجزای اخلاص (فرضیه فرعی دوم)..... ۹۷
- جدول ۴-۱۵- نتایج آزمون F لیمر و بروش- پاگان و هاسمن (فرضیه فرعی سوم)..... ۹۷
- جدول ۴-۱۶- نتایج آزمون‌های تشخیصی (فرضیه فرعی سوم)..... ۹۸
- جدول ۴-۱۷- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس (فرضیه فرعی سوم)..... ۹۸
- جدول ۴-۱۸- نتایج آزمون F لیمر و بروش- پاگان و هاسمن (فرضیه فرعی چهارم)..... ۹۹
- جدول ۴-۱۹- نتایج آزمون‌های تشخیصی (فرضیه فرعی چهارم)..... ۹۹
- جدول ۴-۲۰- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی بین اجزای اخلاص (فرضیه فرعی چهارم)..... ۱۰۰
- جدول ۴-۲۱- نتایج آزمون F لیمر و بروش- پاگان و هاسمن فرضیه فرعی پنجم)..... ۱۰۱
- جدول ۴-۲۲- نتایج آزمون‌های تشخیصی (فرضیه فرعی پنجم)..... ۱۰۱
- جدول ۴-۲۳- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی بین اجزای اخلاص (فرضیه فرعی پنجم)..... ۱۰۲
- جدول ۴-۲۴- نتایج آزمون F لیمر و بروش- پاگان و هاسمن (فرضیه فرعی ششم)..... ۱۰۲
- جدول ۴-۲۵- نتایج آزمون‌های تشخیصی (فرضیه فرعی ششم)..... ۱۰۳
- جدول ۴-۲۶- نتایج تخمین مدل بعد از رفع ناهمسانی واریانس و خودهمبستگی بین اجزای اخلاص (فرضیه فرعی ششم)..... ۱۰۳
- جدول ۴-۲۷- نتایج برآورد مدل اصلی و تخمین الگو به تفکیک مؤلفه‌های شاخص حکمرانی خوب در یک نگاه..... ۱۰۴
- جدول ۵-۱- فرضیه‌ها و نتایج..... ۱۰۸

## فهرست نمودارها

عنوان	صفحه
نمودار ۱-۲- آثار رانت ناشی از ثروت‌های ملی بر سیستم مالیاتی.....	۳۷
نمودار ۲-۲- ارتباط پاسخگویی دولت و قیمت نفت.....	۳۸
نمودار ۳-۲- روند سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در جهان، کشورهای در حال توسعه و کشورهای توسعه- یافته طی سال‌های ۱۹۷۰ تا ۲۰۰۷.....	۴۵
نمودار ۴-۲- روند سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در ایران طی سال‌های ۱۹۷۰ تا ۲۰۰۷.....	۴۶
نمودار ۱-۴- بررسی وضعیت کشورهای مورد بررسی از لحاظ کنترل فساد.....	۸۶
نمودار ۲-۴- بررسی وضعیت کشورهای مورد بررسی از لحاظ کیفیت نهادی.....	۸۶
نمودار ۳-۴- بررسی وضعیت کشورهای مورد بررسی از لحاظ ثبات سیاسی.....	۸۷
نمودار ۴-۴- بررسی وضعیت کشورهای مورد بررسی از لحاظ کیفیت قوانین.....	۸۷
نمودار ۵-۴- بررسی وضعیت کشورهای مورد بررسی از لحاظ قانون‌مداری.....	۸۸
نمودار ۶-۴- بررسی وضعیت کشورهای مورد بررسی از لحاظ اعتراض و پاسخگویی.....	۸۹

## فهرست شکل‌ها

عنوان	صفحه
شکل ۱-۲- روند درآمدهای نفتی، هزینه‌های جاری و هزینه‌های سرمایه‌ای دولت ایران طی سال‌های ۱۹۶۵ - ۲۰۰۷.....	۳۰
شکل ۲-۲- سهم مخارج دولت در بخش‌های مختلف.....	۳۰



فصل اول

کلیات تحقیق



## ۱-۱ مقدمه

کیفیت حکمرانی از جمله مهم‌ترین موضوعاتی است که جوامع تا به امروز با آن مواجه بوده‌اند. رهبران و مسئولان سیاسی همواره تلاش دارند که نظام سیاسی‌شان را کارآمدتر سازند. تمامی حکومت‌ها هدف خود را دستیابی به خیر و مصلحت بیشتر شهروندان اعلام می‌کنند. همه حکومت‌ها مدعی هستند که بسترسازی می‌کنند تا از طریق بهسازی فردی، اجتماعی و نهادی، زمینه حکمرانی خوب را فراهم کنند. اما تا چه اندازه به این مهم دست‌یافته‌اند نیاز به بحث و بررسی دارد. در باب دلالت معنایی حکمرانی باید گفت، حکمرانی در ذات خود تعامل و همکاری بین جامعه مدنی و نظام سیاسی یا تعامل بین دولت و شهروندان را دارد. حکمرانی به پویاها یا فرآیندهای تصمیم‌گیری در جامعه، چگونگی کاربرد قدرت و نحوه روابط دولت و شهروندان (افراد و گروه‌ها) اشاره دارد. به گونه‌ای بنیادین، حکمرانی در پیوند با چگونگی کاربرد قدرت، تعامل و پاسخگویی معنا می‌یابد (کبیری، ۱۳۹۰). امروزه کم‌تر کسی منکر این واقعیت است که نفت، سیاسی‌ترین کالای جهان است و قرار گرفتن حدود ۷۰ درصد ذخایر نفت جهان در کشورهای عضو اوپک، منبع عظیم درآمدی را برای این کشورها فراهم کرده‌است و از آن‌جا که این ثروت بادآورده در دست دولت می‌باشد، می‌تواند نقش مهمی در حکمرانی ایجاد کند. هنگامی که منابع معدنی، منبع اصلی ثروت دولت باشند، این درآمدهای معدنی چارچوب تصمیم‌گیری را تغییر می‌دهند. آن‌ها نه فقط بر محیط سیاست‌گذاری واقعی مقامات رسمی تأثیر می‌گذارند، بلکه سایر جنبه‌های اساسی دولت از قبیل، استقلال در شکل‌گیری اهداف، نوع نهادهای سیاسی اقتباس شده، دورنمای ایجاد قابلیت‌های درآمدزایی و جایگاه اقتدار را نیز متأثر می‌سازند (کارل<sup>۱</sup>، ۱۳۸۸). در نظریه دولت رانتیر اتکا به درآمدهای حاصل از رانت، عامل زیربنایی و تعیین‌کننده سرشت دولت و بی‌نیازی آن از مردم و جامعه دانسته می‌شود. هواداران این نظریه اعتقاد دارند که پویاها سیاسی در دولت‌های مالیات‌گیرنده و دولت‌های نفتی متفاوت است. دیوان سالاری دولت‌های نفتی، غیر عقلایی و فلسفه وجودی آن، اصل دریافت نکردن مالیات در برابر وجود نداشتن نمایندگی است. رابطه معناداری میان تحصیل‌دار بودن دولت و ماهیت غیردموکراتیک آن وجود دارد. به عبارت دیگر، بی‌نیازی اقتصادی و درآمدی دولت از جامعه، علت سرشت غیردموکراتیک رژیم‌های رانتیر است (لوسیانی، ۱۳۷۴). یک دولت تحصیل‌دار به وسیله رانت‌هایی که در اختیار دارد، درصدد جلب حمایت نخبگان و گروه‌های رقیب برای حفظ قدرت انحصاری خود برمی‌آید. بر خلاف اقتصاد تولیدی که کسب ثروت در آن، نتیجه کار و کوشش است، ثروت در دولت رانتیر ناشی از نزدیکی به منابع قدرت، روابط خانوادگی، تصادف و شانس است. بنابراین استعدادهای جامعه به جای نوآوری و فعالیت‌های مولد به سوی روابط ناسالم، دلالی و کسب درآمد آسان سوق می‌یابد (مارش و استوکر<sup>۲</sup>، ۱۳۷۸).

<sup>۱</sup>Karl.<sup>۲</sup>Marsh and Stoker

## ۱-۲ تعریف مسئله و بیان اصلی تحقیق

نفت یکی از مهم‌ترین عوامل تأمین درآمد در کشورهای صادرکننده آن می‌باشد و می‌توان گفت که ارتباط شدیدی بین اقتصاد کشورهای صادرکننده نفت (OPEC) و درآمد نفتی وجود دارد. سازمان کشورهای صادرکننده نفت (OPEC) یک کارتل بین‌المللی نفت است که متشکل از کشورهای الجزایر، کویت، ایران، لیبی، عربستان و...<sup>۱</sup> می‌باشد. این کشورها قریب دوسوم ذخایر نفت جهان را در اختیار دارند و بیش از ۵۰ درصد از کل صادرات این کشورها به صادرات نفت تعلق دارد. کشور ایران با در اختیار داشتن ۱۱ درصد از ذخایر نفت جهان، ۸۰ تا ۹۰ درصد کل درآمد آن از صادرات نفت می‌باشد (قنبری و خضری، ۱۳۹۰). وابستگی به منابع طبیعی از جمله نفت بر روی برخی متغیرها و مکانیسم‌های نامعلومی اثر می‌گذارد که این متغیرها سبب کندی و یا صدمه دیدن رشد اقتصادی می‌شوند. یک چالش مهم برای تئوریسین‌های رشد و اقتصاددانانی که به مطالعه و بررسی تجربی در این گرایش می‌پردازند، مشخص کردن و تعریف نمودن این متغیرها و مکانیسم‌هاست. طبقه‌بندی‌های مختلفی از مکانیسم‌های تأثیرگذاری در مطالعات متعدد ارائه شده است، که طبقه‌بندی استیونس<sup>۲</sup> (۲۰۰۳) نمونه‌ای از آن‌هاست. استیونس در مطالعه خود، مکانیسم‌های اثرگذاری منابع طبیعی بر رشد اقتصادی را به صورت زیر بیان می‌کند (ابراهیمی و سالاریان، ۱۳۸۸):

- ❖ کاهش بلندمدت در رابطه مبادله
- ❖ نوسان درآمدها
- ❖ بیماری هلندی
- ❖ اثر جایگزینی
- ❖ افزایش مداخله دولت در اقتصاد

با توجه به اهمیت نقش دولت در اقتصاد و برای این‌که یک دولت مشخص بتواند وظایف اصلی خود را در زمینه اصلاح نواقص بازار و حذف موارد شکست آن، افزایش رقابت‌پذیری، اصلاحات نهادی، دستیابی به بازارهای آزاد و بهبود سرمایه اجتماعی به درستی انجام دهد، باید از چندین ویژگی برخوردار باشد که در قالب حکمرانی خوب تعریف می‌شود (مرتضوی و همکاران، ۱۳۸۵). امروزه توسعه سیاسی - اقتصادی از مسائل اساسی کشورها می‌باشد و از مباحث مطرح در بحث توسعه، موضوع حکمرانی خوب است. در نظریه حکمرانی خوب رابطه بخش‌های دولت، جامعه مدنی و خصوصی، بحث اصلی توسعه را تشکیل می‌دهند. وجود ویژگی‌هایی مانند حق اظهارنظر و پاسخگویی، بی‌ثباتی سیاسی و خشونت، کیفیت نهادی، کیفیت قوانین و مقررات، حاکمیت قانون و کنترل فساد، می‌تواند عرصه را برای توسعه بخش خصوصی و جامعه

الجزایر، ایران، عراق، کویت، لیبی، نیجریه، قطر، عربستان سعودی، امارات متحده عربی، اکوادور، آنگولا، ونزوئلا<sup>۱</sup>

<sup>۲</sup>Stevens.

مدنی فراهم سازد (رحمانیان کوشکی، ۱۳۹۰). تا اواخر دهه ۱۹۸۰ میلادی درک رایج درباره رابطه فراوانی منابع طبیعی و توسعه اقتصادی این بود که فراوانی منابع طبیعی برای توسعه دارای مزیت است. از اواخر دهه ۱۹۸۰ میلادی، مطالعات فراوانی که این درک سنتی را به چالش می‌کشید پدیدار شدند. این مطالعات نشان داده‌اند که فراوانی منابع طبیعی، احتمال اینکه کشورها نتایج اقتصادی، سیاسی و اجتماعی منفی‌ای را هم-چون عملکرد اقتصادی ضعیف، سطوح پایین دموکراسی و جنگ مدنی را تجربه نمایند، افزایش می‌دهد (بانن و کولیر<sup>۱</sup>، ۲۰۰۳). یک جنبه از حکمرانی خوب می‌تواند احترام گذاشتن به حقوق انسان‌ها، دموکراسی، آزادی بیان، تحت فشار قرار دادن و محدود یا منصوب کردن رهبران، شفافیت تصمیم‌گیری و حاکمیت قانون و به خصوص حذف فقر باشد. از دیدگاه اقتصاد سیاسی، ثروت منابع طبیعی بذر تضاد را بین ذینفعان هم‌چون سیاستمداران، قبایل محلی و شهروندان می‌پاشد و در نتیجه ذینفعان تحت تأثیر رانت‌های غیرمنصفانه منابع طبیعی قرار می‌گیرند (پورکاظمی محمدی، ۱۳۹۰). می‌توان گفت که برای کشورهای عضو اوپک درآمد نفتی مهم‌ترین منبع قدرت، مشروعیت و موجودیت می‌باشد و از آنجا که نفت و انرژی از مؤلفه‌های اساسی تولید ثروت می‌باشد و ثروت و اقتصاد نیز به نوبه خود شرط لازم برای تولید قدرت و امنیت هستند، بین نفت، ثروت، قدرت، امنیت و سیاست پیوند اساسی وجود دارد (حشمت‌زاده، ۱۳۹۰). از آن جایی که منابع نفتی در زیر زمین قرار دارند و استخراج آن مستلزم هزینه‌های زیادی است و بازار فروش آن نیز در خارج از کشور قرار دارد، بنابراین، فقط دولت است که می‌تواند نفت را استخراج و صادر کند و به تبع، درآمد ارزی حاصل از آن نیز مستقیماً به خزانه دولت واریز می‌شود، در نتیجه دولت به یک قدرت بی‌بدیل در مقابل جامعه تبدیل شده و هیچ وابستگی‌ای از لحاظ درآمد به جامعه احساس نمی‌کند. بنابراین، گسترش دامنه دخالت دولت در اقتصاد و بی‌نیاز کردن دولت از پیگیری درآمدهای مالیاتی و در نتیجه عدم پاسخگویی دولت در قبال مردم، باعث ایجاد اخلاق در عملکرد و کارایی دولت و لذا باعث کاهش شاخص حکمرانی خوب دولت می‌گردد.

با توجه به اهمیت درآمدهای نفتی در کشورهای عضو اوپک و این که اختیار و مدیریت این درآمدها در دست دولت می‌باشد و نحوه عملکرد دولت با رشد اقتصادی کشور رابطه مستقیم دارد، از این رو، بررسی تأثیر این درآمدها بر عملکرد دولت کشورهای صادرکننده نفت می‌تواند به رشد اقتصادی این کشورها کمک کند.

با توجه به مطالب فوق سؤال اصلی ما در این تحقیق آن است که آیا درآمدهای نفتی در کشورهای عضو اوپک بر شاخص حکمرانی خوب تأثیر داشته است؟ و این که این تأثیر به چه صورت بوده است؟

### ۱-۳ ضرورت انجام تحقیق

رونق نفتی از چند طریق عملکرد اقتصادهای برخوردار از منابع طبیعی را متأثر می‌سازد که عمده‌ترین آن‌ها عبارتند از:

➤ تحریک رفتارهای رانت‌جویانه و فساد اقتصادی

<sup>1</sup> Bannon and Collier.

- تضعیف حکمرانی و حاکمیت خوب
- اثر جابه‌جایی منابع تولید
- اثر مخارج

بیشتر کشورهای دارنده منابع طبیعی، از درآمدهای مستقل از مالیات در جامعه برخوردارند و به علت وجود این درآمدها، رانت‌جویی و فساد در این کشورها به مراتب بیشتر دیده می‌شود. برخورداری دولت از درآمدهای سرشار ناشی از صدور منابع طبیعی، تمایل برای بهره‌برداری از این منابع در افراد صاحب نفوذ را بالا برده و در نتیجه با ایجاد شبکه‌های وامی- پیرو دست به رانت‌جویی می‌زنند (پناهی و امینی، ۱۳۹۰). از آن‌جا که تقریباً تمامی ذخایر نفتی در کشورهای کمتر توسعه یافته وجود دارد که در آن‌ها عملکرد نهادها بسیار ضعیف است، احتمال نحسی منابع بسیار بالا می‌باشد. در این کشورها که اقتصاد آن‌ها وابسته به نفت است، فساد بیشتر، کارایی حکومت ضعیف‌تر و دارای سطح بالایی از درگیری و جنگ می‌باشند (کارل<sup>۱</sup>، ۲۰۰۷). تجربه ایران و اکثر کشورهای صادرکننده منابع طبیعی نشان می‌دهد که در صورت عدم مدیریت صحیح و برنامه‌ریزی شده درآمدهای حاصل از فروش این منابع، مشکلاتی برای اقتصاد این کشورها به وجود خواهد آمد که برخی از آن‌ها عبارتند از:

- بروز پدیده بیماری هلندی و گسترش تورم در اقتصاد
- از بین رفتن اصل سرمایه‌ها (عدم رعایت تعادل بین نسلی)
- ورود نوسان‌های قیمت منابع به اقتصاد کشور
- عدم کشف توانمندی‌ها و ظرفیت در اقتصاد کشور
- گسترش دامنه دخالت دولت در اقتصاد و بی‌نیاز کردن دولت از پیگیری درآمدهای مالیاتی و در نتیجه عدم پاسخگویی دولت در قبال مردم

و با توجه به اینکه درآمدهای حاصل از صادرات نفت در اختیار دولت قرار دارد، لذا نوع سیاست‌های به کارگرفته از سوی دولتمردان در رویارویی با افزایش درآمدهای نفتی و نیز نحوه هزینه کردن این درآمدها، نقش درخور توجهی در چگونگی بروز مشکلات فوق‌الذکر دارد (نیکو قدم، ۱۳۸۸).

در کشورهای دارای منابع طبیعی فراوان، دولت‌ها به علت بهره‌مندی از رانت‌های عظیم منابع، بسیار بزرگ و حجیم می‌شوند و این امر منجر به برون‌رانی بخش خصوصی توسط بخش دولتی شده و دولت‌ها به جای انجام فعالیت‌های مکمل بازار، به فعالیت‌های جانشین می‌پردازند. یعنی به جای این‌که دولت‌ها به عنوان پشتیبان بخش خصوصی عمل نمایند، به صورت رقیب بخش خصوصی در عرصه اقتصاد ظاهر می‌شوند و نتیجه این امر آن است که منابع کشور به صورت ناکارآمد تخصیص می‌یابند (رنانی، ۱۳۸۱). شایان ذکر است که نفت به عنوان یک عنصر اساسی اقتصاد سیاسی ایران، زمینه را برای تبدیل دولت از یک نهاد داور یا ناظر به یک بازیگر قدرتمند و رقیب بخش خصوصی فراهم کرده است و از این رو دولت را از اجرای کارکردهای

<sup>۱</sup>Karl.