

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



۹۰۱۱۰۱۰

دانشگاه شهید چمران اهواز

دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی

گروه علوم اقتصادی

پایان نامه کارشناسی ارشد

عنوان پایان نامه

رابطه بین تورم و رشد بهره‌وری در کشورهای منتخب عضو سازمان کنفرانس اسلامی

اساتید راهنما

دکتر منصور زراء نژاد

دکتر امیرحسین منتظرالحجت

استاد مشاور

دکتر مسعود خداپناه

تحقیق و نگارش

نازنین نصیریان

شهریور ۱۳۹۱

تقدیم به خدایی که آفرید جهان را، انسان را، عقل را، علم را، معرفت را، عشق را

تقدیم به مادر دلسوز و مهربانم، مقدس‌ترین واژه در لغت‌نامه دلم که زندگی را مدیون مهر و

عطوفت او میدانم.

تقدیم به پدر عزیزم، مشوق همیشگی و حامیم در تمام لحظات زندگی‌ام.

تقدیم به همسرم، که مسیح‌وار با صبرش در تمامی لحظات رفیق راه بود.

تقدیم به برادر و خواهرم، همراهان همیشگی و پشتوانه‌های زندگی‌م.

## تقدیر و تشکر

بدون شک به پایان رساندن این رساله بدون لطف حضرت حق و نیز رهنمودهای اساتید محترم میسر نمی‌شد. لذا بر خود لازم می‌دانم که از اساتید و افرادی که من را در این امر یاری نمودند، نام برده و سپاس خود را تقدیم‌شان نمایم.

با تشکر و سپاس از استاد دانشمند و پرمایه‌ام جناب آقای دکتر منصور زراءنژاد که در کمال سعه صدر، با حسن خلق و فروتنی، از هیچ کمکی در این عرصه بر من دریغ ننمودند و زحمت راهنمایی این رساله را بر عهده گرفتند. همچنین با امتنان بیکران از مساعدت‌های بی‌شائبه دکتر امیرحسین منتظرحجت و دکتر مسعود خداپناه، که بدون مساعدت‌شان، این پایان‌نامه به نتیجه مطلوب نمی‌رسید. و با سپاس بی‌دریغ خدمت سرکار خانم اهوازی که مرا صمیمانه یاری داده‌اند.

و با تشکر از دوستان گران‌مایه‌ام بخصوص آقای صلاح ابراهیمی که به نوعی مرا در به انجام رساندن این مهم یاری نموده‌اند.

در پایان از تمامی اساتید بزرگوار و کارمندان دانشکده و آنانی که کلمه‌ای به من آموختند سپاس‌گزاری می‌نمایم.

## فهرست مطالب

### چکیده

### فصل اول: کلیات تحقیق

۲	۱-۱- مقدمه
۳	۱-۲- بیان مسئله
۵	۱-۳- ضرورت و اولویت تحقیق
۶	۱-۴- اهداف و خروجی‌های مورد انتظار تحقیق
۷	۱-۵- پرسش‌ها و فرضیه‌های تحقیق
۷	۱-۶- رویکرد اجرایی تحقیق
۸	۱-۷- حدود تحقیق
۸	۱-۸- تعریف متغیرهای تحقیق
۸	۱-۸-۱- بهره‌وری
۸	۱-۸-۲- تورم
۹	۱-۸-۳- سازمان کنفرانس اسلامی
۱۰	۱-۸-۴- شاخص تحقیق و توسعه

۱۰	۱-۸-۵- شاخص توسعه انسانی
۱۱	۱-۸-۶- تجارت
۱۱	۱-۸-۷- نرخ بهره
۱۱	۱-۹- ساختار رساله
۱۲	۱-۱۰- خلاصه
	<b>فصل دوم: مبانی نظری</b>
۱۴	۲-۱- مقدمه
۱۵	۲-۲- بهره‌وری
۱۵	۲-۲-۱- برخی تعاریف پایه‌ای بهره‌وری
۱۸	۲-۲-۲- تاریخچه بهره‌وری در اندیشه‌های اقتصادی
۲۱	۲-۲-۳- اهمیت بهره‌وری
۲۲	۲-۲-۴- برداشت‌های نادرست از مفهوم بهره‌وری
۲۵	۲-۲-۵- چرخه بهره‌وری
۲۶	۲-۲-۵-۱- اندازه‌گیری بهره‌وری
۲۷	۲-۲-۵-۲- ارزیابی و تحلیل شاخص‌ها

۲۷	۲-۲-۵-۳- برنامه‌ریزی بهره‌وری
۲۸	۲-۲-۵-۴- بهبود بهره‌وری
۲۸	۲-۲-۶- سطوح بهره‌وری
۲۸	۲-۲-۶-۱- بهره‌وری در سطح بین‌المللی
۲۹	۲-۲-۶-۲- بهره‌وری در سطح ملی
۳۰	۲-۲-۶-۳- بهره‌وری در سطح بخش
۳۰	۲-۲-۶-۴- بهره‌وری در سطح سازمان و شرکت
۳۰	۲-۲-۶-۵- بهره‌وری فرد شاغل
۳۱	۲-۲-۷- روش‌های سنجش بهره‌وری
۳۱	۲-۲-۷-۱- روش شاخص
۳۲	الف- شاخص‌های جزئی بهره‌وری عوامل تولید
۳۲	الف-۱- شاخص بهره‌وری نیروی کار
۳۳	الف-۲- شاخص بهره‌وری سرمایه
۳۳	ب- شاخص‌های کلی بهره‌وری
۳۳	ب-۱- شاخص بهره‌وری کل عوامل

- ۳۴ ۲-۲-۷-۲- روش داده - ستانده
- ۳۵ ۲-۲-۷-۳- روش تابع تولید
- ۳۵ ۲-۲-۸-۸- رابطه بهره‌وری و دیگر متغیرهای کلان اقتصادی
- ۳۵ ۲-۲-۸-۱- رابطه بهره‌وری و شاخص توسعه انسانی
- ۳۶ ۲-۲-۸-۲- رابطه بهره‌وری و نرخ بهره حقیقی
- ۳۷ ۲-۲-۸-۳- رابطه بهره‌وری و تجارت
- ۳۹ ۲-۲-۸-۴- رابطه بهره‌وری و شاخص تحقیق و توسعه
- ۴۰ ۲-۲-۸-۵- رابطه بهره‌وری و اشتغال
- ۴۰ ۲-۲-۸-۶- رابطه بهره‌وری و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی
- ۴۱ ۲-۲-۹-۹- عوامل موثر بر بهره‌وری
- ۴۲ ۲-۳-۳- تورم
- ۴۲ ۲-۳-۱- مبانی نظری تورم
- ۴۳ ۲-۳-۲- برخی تعاریف تورم
- ۴۵ ۲-۳-۳- علل تورم
- ۴۶ ۲-۳-۳-۱- تورم ناشی از فشار تقاضا



- ۴۷ ۲-۳-۳-۲- تورم ناشی از فشار هزینه‌ها
- ۴۸ ۲-۳-۳-۳- تورم ساختاری
- ۴۸ ۲-۳-۴- آثار تورم
- ۴۸ ۲-۳-۴-۱- تورم و نااطمینانی تورم
- ۴۹ ۲-۳-۴-۲- تورم و سرمایه‌گذاری
- ۵۰ ۲-۳-۴-۳- تورم و اشتغال
- ۵۱ ۲-۳-۴-۴- تورم و نرخ بهره
- ۵۱ ۲-۳-۵- اثر تورم در بلندمدت
- ۵۲ ۲-۳-۶- روش‌های مبارزه با تورم
- ۵۳ ۲-۴- مبانی نظری حوزه بهره‌وری و تورم
- ۵۴ ۲-۴-۱- اثر بهره‌وری بر تورم
- ۵۶ ۲-۴-۲- اثر تورم بر بهره‌وری
- ۵۸ ۲-۴-۳- تورم و بهره‌وری نیروی کار
- ۵۹ ۲-۴-۳-۱- تورم و کاهش سطح سلامت نیروی کار
- ۶۱ ۲-۴-۳-۲- تورم و کاهش سطح آموزش نیروی کار

۶۲	۲-۴-۳-۳- تورم و انگیزه نیروی کار
۶۳	۲-۴-۴- رابطه مثبت تورم و بهره‌وری
۶۳	۲-۴-۴-۱- تورم پایین محرکی برای افزایش بهره‌وری
۶۴	۲-۴-۴-۲- تورم بخشی و افزایش بهره‌وری
۶۴	۲-۵- خلاصه
	<b>فصل سوم: پیشینه تحقیق</b>
۶۷	۳-۱- مقدمه
۶۷	۳-۲- مطالعات خارجی انجام شده
۷۴	۳-۳- مطالعات داخلی انجام شده
۷۷	۳-۴- خلاصه
	<b>فصل چهارم: روش تحقیق و تخمین مدل</b>
۷۹	۴-۱- مقدمه
۷۹	۴-۲- داده‌های پانل
۸۱	۴-۲-۱- مزایای استفاده از داده‌های پانل
۸۲	۴-۲-۲- معرفی چارچوب مدل‌های پانل دیتا

- ۸۳ ۴-۲-۱-مدل اثرات ثابت
- ۸۴ ۴-۲-۲-مدل اثرات تصادفی
- ۸۵ ۴-۳-پایایی
- ۸۶ ۴-۳-۱-درجه پایایی
- ۸۶ ۴-۳-۲-آزمون ریشه واحد برای بررسی پایایی متغیرها
- ۸۸ ۴-۳-۱-آزمون لوین، لین و چو
- ۹۰ ۴-۳-۲-آزمون ایم، پسران و شین
- ۹۱ ۴-۳-۲-آزمون فیلیپس - پرون
- ۹۲ ۴-۴-آزمون‌های علیت
- ۹۲ ۴-۴-۱-آزمون علیت گرنجر
- ۹۳ ۴-۴-۲-آزمون علیت سیمز
- ۹۴ ۴-۴-۳-آزمون علیت تودا و یاماموتو
- ۹۶ ۴-۳-۱-مزایای روش تودا و یاماموتو
- ۹۶ ۴-۵-روش گشتاورهای تعمیم یافته
- ۱۰۰ ۴-۶-آزمون‌های تشخیصی

- ۱۰۰ ۴-۶-۱- آزمون چاو
- ۱۰۲ ۴-۶-۲- آزمون خودهمبستگی وولدريج
- ۱۰۲ ۴-۶-۳- آزمون والد
- ۱۰۲ ۴-۶-۴- آزمون سارگان
- ۱۰۳ ۴-۶-۵- آزمون خودهمبستگی آرلانو - بوند
- ۱۰۳ ۴-۷-۷- تخمين مدل
- ۱۰۵ ۴-۷-۱- نتايج بررسي آزمون ريشه واحد براي رشد بهره‌وري و تورم
- ۱۰۶ ۴-۷-۲- نتايج تعيين وقفه بهينه براي رشد بهره‌وري و تورم
- ۱۰۷ ۴-۷-۳- نتايج آزمون‌هاي علليت براي رشد بهره‌وري و تورم
- ۱۰۷ الف- نتايج آزمون علليت گرنجر
- ۱۰۸ ب- نتايج آزمون علليت سيمز
- ۱۰۸ ج- نتايج آزمون علليت تودا و ياماموتو
- ۱۰۹ ۴-۷-۴- معرفي مدل و متغيرهاي بكار رفته
- ۱۱۱ ۴-۷-۵- بررسي آزمون چاو براي مدل تورم و رشد بهره‌وري
- ۱۱۱ ۴-۷-۶- آزمون خودهمبستگی وولدريج

- ۱۱۲ ۷-۷-۴- تخمین و برآورد مدل رشد بهره‌وری و تورم
- ۱۱۴ ۸-۷-۴- بررسی مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۱۴ ۱-۸-۷-۴- بررسی آزمون ریشه واحد برای متغیر بهره‌وری
- ۱۱۴ ۲-۸-۷-۴- تعیین وقفه بهینه برای مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۱۵ ۳-۸-۷-۴- بررسی آزمون‌های علیت بین بهره‌وری و تورم
- ۱۱۵ الف- آزمون علیت گرنجر بین بهره‌وری و تورم
- ۱۱۶ ب- آزمون علیت سیمز بین بهره‌وری و تورم
- ۱۱۶ ج- آزمون علیت تودا و یاموتو بین بهره‌وری و تورم
- ۱۱۷ ۴-۸-۷-۴- معرفی مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۱۸ ۵-۸-۷-۴- آزمون چاو برای مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۱۸ ۶-۸-۷-۴- آزمون خودهمبستگی وولدریج
- ۱۱۹ ۷-۸-۷-۴- برآورد مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۲۰ ۹-۷-۴- معرفی مدل و متغیرهای بکار رفته در رابطه غیرخطی
- ۱۲۲ ۱-۹-۷-۴- برآورد مدل غیرخطی
- ۱۲۴ ۱۰-۷-۴- بررسی آزمون‌های تشخیصی مدل

۱۲۴	۴-۷-۱۰-۱-آزمون والد
۱۲۵	۴-۷-۱۰-۲-آزمون سارگان
۱۲۶	۴-۷-۱۰-۳-آزمون خودهمبستگی آرلانو و بوند
۱۲۶	۴-۷-۱۱-خلاصه

### فصل پنجم: نتیجه‌گیری و پیشنهادات

۱۳۰	۵-۱-مقدمه
۱۳۰	۵-۲-خلاصه پژوهش
۱۳۳	۵-۳-نتایج پژوهش
۱۳۵	۵-۴-محدودیت‌های تحقیق
۱۳۵	۵-۵-پیشنهادات تحقیق

### منابع

۱۳۸	منابع و ماخذ
-----	--------------

### پیوست

۱۴۹	جدول ۱-آزمون ریشه واحد متغیر رشد بهره‌وری
۱۵۰	جدول ۲-آزمون ریشه واحد متغیر تورم

- ۱۵۱ جدول ۳- آزمون ریشه واحد متغیر بهره‌وری
- ۱۵۲ جدول ۴- آزمون ریشه واحد متغیر نرخ بهره
- ۱۵۳ جدول ۵- آزمون ریشه واحد متغیر تجارت
- ۱۵۴ جدول ۶- آزمون ریشه واحد متغیر تحقیق و توسعه
- ۱۵۵ جدول ۷- آزمون ریشه واحد شاخص توسعه انسانی
- ۱۵۶ جدول ۸- آزمون ریشه واحد توان دوم متغیر تورم
- ۱۵۷ جدول ۹- تعیین وقفه بهینه تورم و رشد بهره‌وری
- ۱۵۸ جدول ۱۰- آزمون علیت گرنجر تورم و رشد بهره‌وری
- ۱۵۹ جدول ۱۱- آزمون علیت سیمز از تورم به رشد بهره‌وری
- ۱۶۰ جدول ۱۲- آزمون علیت سیمز از رشد بهره‌وری به تورم
- ۱۶۱ جدول ۱۳- آزمون علیت تودا و یاماموتو از تورم به رشد بهره‌وری
- ۱۶۲ جدول ۱۴- آزمون علیت تودا و یاماموتو از رشد بهره‌وری به تورم
- ۱۶۳ جدول ۱۵- آزمون چاو برای مدل رشد بهره‌وری و تورم
- ۱۶۴ جدول ۱۶- آزمون خودهمبستگی وولدریج برای مدل رشد بهره‌وری و تورم
- ۱۶۵ جدول ۱۷- برآورد مدل رشد بهره‌وری و تورم

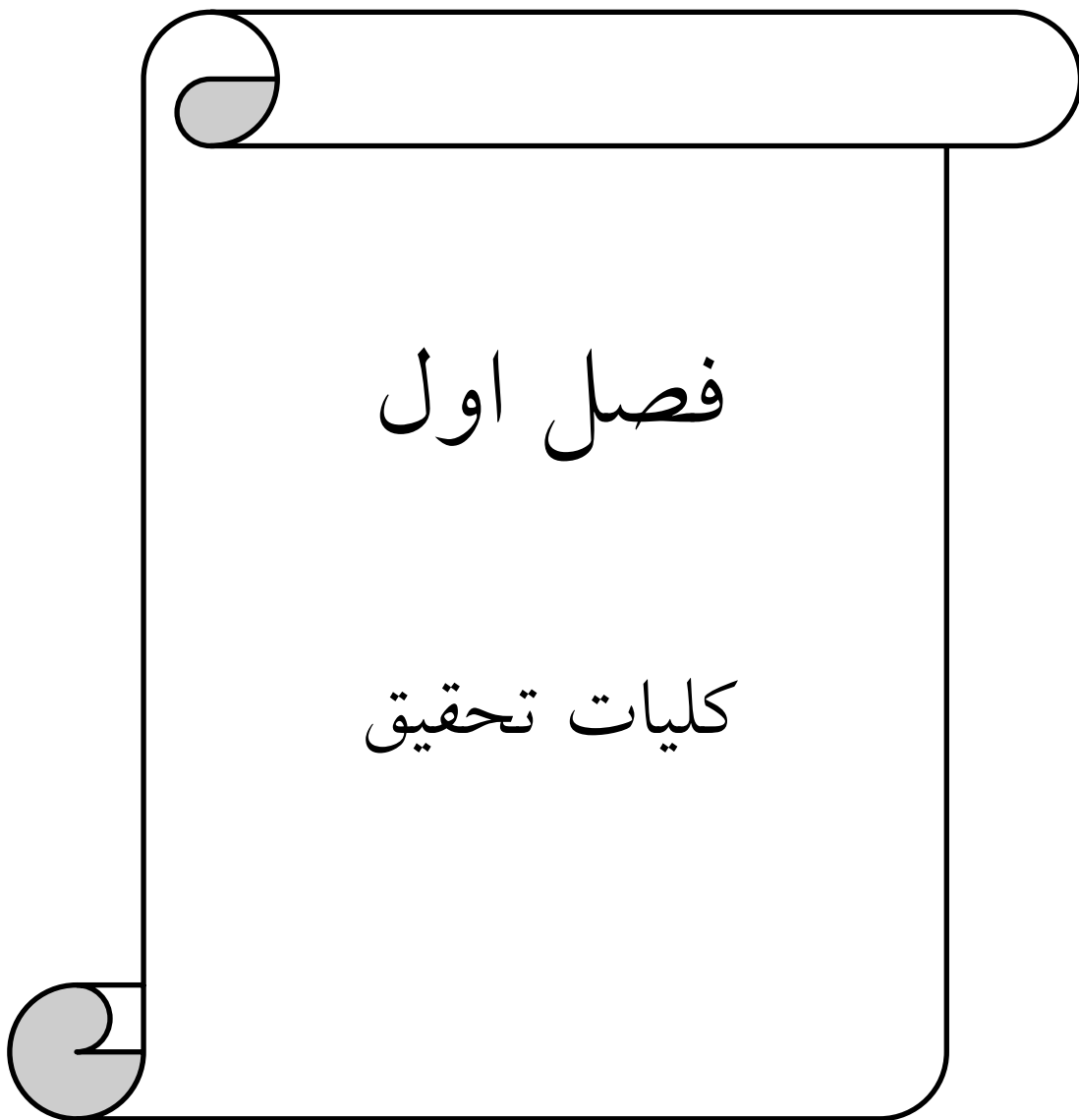
- ۱۶۶ جدول ۱۸- نتایج آزمون خودهمبستگی آرلانو - بوند بعد از تخمین مدل از روش GMM
- ۱۶۷ جدول ۱۹- تعیین وقفه بهینه بهره‌وری و تورم
- ۱۶۸ جدول ۲۰- آزمون علیت گرنجر بین بهره‌وری و تورم
- ۱۶۸ جدول ۲۱- آزمون علیت سیمز از تورم به بهره‌وری
- ۱۷۰ جدول ۲۲- آزمون علیت سیمز از بهره‌وری به تورم
- ۱۷۱ جدول ۲۳- آزمون علیت تودا و یاماموتو از تورم به بهره‌وری
- ۱۷۲ جدول ۲۴- آزمون علیت تودا و یاماموتو از بهره‌وری به تورم
- ۱۷۳ جدول ۲۵- آزمون چاو برای مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۷۴ جدول ۲۶- آزمون خودهمبستگی وولدریج برای مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۷۵ جدول ۲۷- تخمین مدل بهره‌وری و تورم
- ۱۷۶ جدول ۲۸- نتایج آزمون خودهمبستگی آرلانو - بوند بعد از تخمین مدل به روش GMM
- ۱۷۷ جدول ۲۹- آزمون چاو برای مدل توان دوم بهره‌وری و تورم
- ۱۷۸ جدول ۳۰- آزمون خودهمبستگی وولدریج برای مدل درجه دوم بهره‌وری
- ۱۷۹ جدول ۳۱- تخمین مدل تابع درجه دوم بهره‌وری
- ۱۸۰ جدول ۳۲- نتایج آزمون والد برای مدل درجه دوم بهره‌وری



- ۱۸۰ جدول ۳۳- نتایج آزمون سارگان مدل درجه دوم بهره‌وری
- ۱۸۰ جدول ۳۴- نتایج آزمون خودهمبستگی آرلانو - بوند بعد از تخمین مدل از روش GMM
- ۱۸۱ جدول ۳۵- اسامی کشورهای مورد بررسی

نام خانوادگی : نازنین	نام : نصیریان	شماره دانشجویی : ۹۰۱۱۰۱۱
عنوان پایان نامه : رابطه بین تورم و رشد بهره‌وری در کشورهای منتخب عضو سازمان کنفرانس اسلامی		
استاد/ اساتید راهنما : دکتر منصور زراءنژاد/ دکتر امیرحسین منتظرالحجت		
استاد/ اساتید مشاور : دکتر مسعود خداپناه		
درجه تحصیلی : کارشناسی ارشد	رشته : اقتصاد	گرایش : علوم اقتصادی
دانشگاه : شهید چمران اهواز	دانشکده : اقتصاد و علوم اجتماعی	گروه : اقتصاد
تاریخ فارغ التحصیلی : ۱۳۹۲/۰۶/۳۱		تعداد صفحه: ۲۰۲
کلید واژه ها : رشد بهره‌وری، تورم، رابطه علیت، روش گستاورهای تعمیم یافته		
<p>رشد بهره‌وری ضرورت هر اقتصاد پویا و رو به رشد به شمار می‌رود و موجبات بهبود وضعیت اقتصادی هر کشور را فراهم می‌آورد. با توجه به نقش مهم بهره‌وری در بهبود سطح رفاه کشورها، بسیاری از پژوهشگران و محققان به دنبال بررسی عوامل موثر بر بهره‌وری بوده‌اند. یکی از مهمترین متغیرهای اقتصادی اثرگذار در این مطالعات، متغیر تورم بوده است. تورم بالا در اقتصاد، به عقیده بسیاری از اقتصاددانان، رشد بهره‌وری را با اختلال روبه‌رو می‌سازد. در واقع، تورم بالا افزون بر دیگر پیامدهای نامطلوب رفاهی، تأثیر به‌سزایی در کند شدن فرآیند رشد اقتصادی و کاهش بهره‌وری دارد.</p> <p>هدف از انجام این تحقیق بررسی رابطه میان رشد بهره‌وری و تورم در کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی در طی دوره ۱۹۹۸-۲۰۱۰ است. ابتدا به بررسی ایستایی متغیرها با استفاده از آزمون‌های ریشه واحد (ایم، پسران و شین، لوین، لین و چو و فلیپس - پرون) پرداخته شد و نتایج حاصل از آن نشان داد که تمامی متغیرها ایستا از درجه صفر بودند. سپس با توجه به معیار آکاییک وقفه بهینه دو تعیین شد. پس از آن به بررسی آزمون‌های علیت برای تعیین جهت رابطه این دو متغیر پرداخته شد.</p>		

نتیجه حاصل از آن‌ها نشان داد که رابطه علیت از تورم به سمت رشد بهره‌وری و نیز بهره‌وری است. سپس با توجه به این نتیجه به برآورد مدل با استفاده از روش گشتاورهای تعمیم یافته پرداختیم. نتایج، حاکی از وجود رابطه منفی و معنادار میان تورم و رشد بهره‌وری است. بدان معنا که با کاهش تورم در کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی، رشد بهره‌وری بهبود می‌یابد. همچنین بین تورم و بهره‌وری نیز رابطه منفی و معناداری وجود دارد. همچنین ضرایب سایر متغیرهای مستقل مدل (تجارت، نرخ بهره، شاخص توسعه انسانی و شاخص تحقیق و توسعه)، معنادار و سازگار با تئوری‌ها بدست آمدند. در پایان، آزمون‌های تشخیصی مدل (والد، سارگان، خودهمبستگی آرانو - بوند) مورد بررسی قرار گرفتند که نتایج آن‌ها نشان داد که مدل برآورد شده معتبر و صحیح است و برازش مدل به خوبی صورت گرفته است.



# فصل اول

کلیات تحقیق