

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشگاه رازی

دانشکده علوم اجتماعی

گروه اقتصاد

پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته ی اقتصاد

عنوان پایان نامه

تأثیر جهانی شدن و آزادسازی مالی بر اندازه دولت در ایران طی دوره

۱۳۳۸-۱۳۸۶

استاد راهنما:

دکتر الماسی

استاد مشاور:

دکتر فلاحتی

نگارش:

محسن زنگنه

زمستان ۸۷



دانشکده علوم اجتماعی
گروه اقتصاد

پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته ی اقتصاد
محسن زنگنه

عنوان پایان نامه

تأثیر جهانی شدن و آزادسازی مالی بر اندازه دولت در ایران طی دوره ۱۳۸۶-۱۳۳۸

در تاریخ	توسط هیأت داوران زیر بررسی و با درجه	به تصویب نهایی رسید.		
۱- استاد راهنما	دکتر الماسی	با مرتبه ی علمی	استادیار	امضاء
۲- استاد مشاور	دکتر فلاحتی	با مرتبه ی علمی	استادیار	امضاء
۳- استاد داور	دکتر سهیلی	با مرتبه ی علمی	استادیار	امضاء
۴- استاد داور	دکتر نظیری	با مرتبه ی علمی	استادیار	امضاء

کلیه حقوق مادی مترتب بر نتایج مطالعات، ابتکارات و
نوآوری های ناشی از تحقیق موضوع این پایان نامه
متعلق به دانشگاه رازی است.

تقدیم به:

مادر دلسوز و مهربانم

و روح پدر بزرگوار و عزیزم

سپاسگزاری

باتشکر از استاتید ارجمند دکتر الماسی، دکتر فلاحتی، دکتر سهیلی

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول: کلیات
۲	مقدمه
۳	۱-۱- بیان مسئله
۳	۲-۱- ضرورت و اهمیت موضوع
۳	۳-۱- اهداف تحقیق
۴	۴-۱- فرضیات تحقیق
۴	۵-۱- روش انجام تحقیق
۵	فصل دوم: پیشینه نظری و ادبیات موضوع
۶	مقدمه
۷	۱-۲- مفهوم جهانی شدن
۸	۲-۱-۲- سابقه تاریخی جهانی شدن
۸	۳-۱-۲- بررسی روند جهانی شدن و عوامل موثر بر آن
۹	۴-۱-۲- ویژگی های جهانی شدن
۱۰	۵-۱-۲- اثرات جهانی شدن
۱۱	۶-۱-۲- ابزارهای جهانی شدن
۱۳	۷-۱-۲- تاریخچه گات
۱۴	۸-۱-۲- دور اروگوئه
۱۴	۱-۸-۱-۲- ویژگیهای اصلی نتایج دور اروگوئه
۱۵	۹-۱-۲- سازمان تجارت جهانی
۱۶	۱۰-۱-۲- وظایف سازمان تجارت جهانی
۱۶	۱۱-۱-۲- تئوری کلاسیک ها در تجارت بین الملل
۱۷	۱۲-۱-۲- نظریه مزیت نسبی ریکاردو
۱۸	۱۳-۱-۲- جان استوارت میل و تقسیم آثار تجارت
۱۸	۱۴-۱-۲- تئوری نئو کلاسیک در تجارت بین الملل
۱۹	۱۵-۱-۲- تئوری هکشر - اوهلین
۱۹	۱۶-۱-۲- منتقدان تجارت آزاد

صفحه	عنوان
۱۹	۱-۱۶-۱-۲- نظریات فردریک لیست
۲۰	۲-۱۶-۱-۲- دیدگاههای راثول پریش
۲۱	۳-۱۶-۱-۲- هانس سینگر و اختلافات ساختاری
۲۲	۴-۱۶-۱-۲- گونار میردال
۲۲	۲-۲- اندازه دولت
۲۳	۱-۲-۲- فلاسفه باستان و دولت
۲۳	۲-۲-۲- مركاتیلیسم
۲۴	۳-۲-۲- فیزیوکراسی
۲۴	۴-۲-۲- مکتب کلاسیک اقتصادی
۲۵	۵-۲-۲- سوسیالیسم
۲۶	۶-۲-۲- مکتب تاریخی
۲۷	۷-۲-۲- مکتب نهادگرایی
۲۷	۸-۲-۲- مکتب نئوکلاسیک
۲۷	۹-۲-۲- کینز و رویکرد کینزی
۲۸	۱۰-۲-۲- مکتب شیکاگو
۲۸	۱۱-۲-۲- کلاسیکهای جدید
۲۹	۱۲-۲-۲- کینزی های جدید
۲۹	اقتصاد بخش عمومی و دولت (نئوکلاسیک در بستر واقعیت)
۳۰	۳-۲- سرمایه گذاری خارجی
۳۰	۱-۳-۲- اشکال سرمایه گذاری مستقیم خارجی
۳۰	۲-۳-۲- روند سرمایه گذاری خارجی در ایران
۳۱	۳-۳-۲- موانع سرمایه گذاری در ایران
۳۳	۴-۲- پیشینه تحقیق
۳۳	۱-۴-۲- مطالعات انجام شده در زمینه جهانی شدن و اندازه دولت و سرمایه گذاری خارجی
۳۶	۲-۴-۲- کارهای تجربی انجام شده در زمینه جهانی شدن

صفحه	عنوان
۴۱	فصل سوم: روش تحقیق
۴۲	مقدمه
۴۳	۳-۱- روش تحقیق
۴۳	۳-۱-۱- شاخص سطح تجارت بین الملل (LIT)
۴۳	۳-۱-۲- شاخص ادغام تجارت بین الملل (IIT)
۴۳	۳-۱-۳- شاخصهای ترکیبی
۴۴	۳-۱-۳-۱- شاخص آزادی اقتصادی بنیاد هریتیج
۴۴	۳-۱-۳-۲- شاخص آزادی اقتصادی موسسه فریزر
۴۵	۳-۱-۳-۴- شاخص های غیر ترکیبی
۴۵	۳-۱-۴-۱- شاخص های باز بودن تجاری
۴۵	۱. شاخص های وقوعی
۴۶	۲. شاخص های پیامدی
۴۶	الف) شاخص های نسبت نفوذ واردات
۴۷	ب) شاخص شکاف قیمتی
۴۷	ج) شاخص اضافه بها نرخ ارز در بازار سیاه
۴۷	د) شاخص شدت تجاری $(X-M)/GDP$
۵۱	۳-۱- شاخص های باز بودن مالی
۵۲	۳-۲- فرآیند جهانی شدن در آئینه شاخص ها
۵۳	۳-۳- ایران و فرآیند جهانی شدن اقتصاد
۶۱	فصل چهارم: تجزیه و تحلیل یافته های تحقیق
۶۲	مقدمه
۶۳	۴-۱- ارائه مدل، برازش ، تفسیر نتایج
۶۳	۴-۱-۱- ارائه مدل
۶۴	۴-۱-۲- برازش مدل، تفسیر نتایج
۶۷	۴-۱-۳- تعیین وقفه بهینه در مدل VAR
۶۷	۴-۱-۴- تخمین الگوی VAR
۷۰	تحلیل شوک داده ها و مدت استهلاك آنها

صفحه

۷۴

۷۷

۸۳

۸۶

عنوان

یافته های جداول استنباطی

فصل پنجم: جمع بندی و نتیجه گیری

منابع و مأخذ

ضمائم

چکیده

با توجه به نقش مهم تجارت جهانی در صحنه اقتصاد بین الملل و تلاش کشورها برای گسترش سهم خود در تجارت جهانی در دوران پس از جنگ جهانی دوم و به منظور بهره مندی بیشتر از مزایای بازرگانی، کشورها پیوسته در کار فراهم ساختن شرایط و زمینه های مساعد برای هماهنگی بیشتر در رویه ها و رفتارهای تجاری میان خود بوده اند. برای بررسی هر گونه ارتباط جهانی شدن تجارت، با دیگر متغیرها، نیازمند کمی کردن این پدیده و انتخاب شاخص مناسب برای آن می باشیم. شاخصهای زیادی برای جهانی شدن اقتصاد طراحی و ارائه گردیده اند ولی انتخاب شاخص مناسب برای متغیرها، بویژه متغیرهای جهانی شدن اهمیت زیادی دارد زیرا که می تواند نتایج پژوهش را تحت تأثیر قرار دهد.

در میان شاخص ها یکی از معروفترین و پرکارترین شاخص ها شاخص باز بودن تجاری می باشد که در بسیاری از مطالعات مورد استفاده قرار گرفته است. پس بنابر اهمیت انتخاب شاخص مناسب ما در این تحقیق از شاخص درجه باز بودن اقتصاد (نسبت تجارت به GDP) استفاده کرده ایم.



**Faculty of social sciences
Department of economic**

M.Sc.Thesis

Title of the Thesis
**Effect of globalization and liberalization of financial markets on size of
government in Iran during (۱۳۳۸-۱۳۸۶)**

**Supervisor :
Dr. Almasi**

**Advisor:
Dr. falahati**

**By:
Mohsen zangeneh**

February ۲۰۰۹



**Faculty of social sciences
Department of economic**

M.Sc.Thesis

Title of the Thesis

**Effect of globalization and liberalization of financial markets on size of
government in Iran during (۱۳۳۸-۱۳۸۶)**

By:

Mohsen zangeneh

Evaluated and approved by thesis committees:

Supervisor: Dr. almasi

Advisor: Dr. Falahati

Examiner: Dr. Sohaili

Examiner: Dr. naziri.

February 2009

فصل اول

کلیات

مقدمه

درفصل حاضر ابتدا ضرورت و اهمیت پژوهش در مورد تأثیر جهانی شدن و آزاد سازی مالی بر اندازه های دولت در ایران از سال ۱۳۸۶ - ۱۳۳۸ تشریح گردیده است. سپس اهداف این پژوهش به همراه فرضیه ها و روش تحقیق مورد بررسی قرار گرفته است.

۱-۱- بیان مسئله

بیشتر اقتصاد دانان معتقدند که تجارت بین المللی موتور توسعه در جوامع امروزی می باشد، زیرا که تجارت بین المللی امکان بهره گیری از توانمندیهای اقتصادی بالقوه را با توجه به مزیت نسبی فراهم می آورد پس به همین دلیل پیوستن به اقتصاد جهانی امری اجتناب ناپذیر شده است. یکی از موضوعاتی که اخیراً مورد توجه اقتصاد دانان قرار گرفته است. موضوع مربوط به ارتباط میان جهانی شدن تجارت و اندازه دولت می باشد و همچنین یکی از مسائل و دغدغه های اساسی در پیوستن به سازمان تجارت جهانی جذب سرمایه و بازار مالی کشورها از جمله کشور ما می باشد. شکوفایی و تسریع مداوم رشد اقتصادی کشور مستلزم شناخت و کاربرد سیاست های بنیادی اقتصاد می باشد. که یکی از این سیاستها، توسعه سریع بازارهای مالی و سرمایه کشور می باشد. که سرمایه گذاری موثر خارجی می تواند در این راه، ره گشا باشد. در ادبیات تجربی، شاخص های زیادی برای جهانی شدن اقتصاد طراحی و ارائه شده است. در این میان معروف ترین و معمول ترین شاخص، شاخص باز بودن تجارتی در ادبیات تجربی است. که در بسیاری از مطالعات مورد استفاده قرار گرفته است لذا شاخص باز بودن اقتصاد (نسبت تجارت به *GDP*) برای این پژوهش انتخاب شده است. مبنای زمانی برای تحقیق دوره ۱۳۳۸-۱۳۸۶ می باشد.

۱-۲- ضرورت و اهمیت موضوع

ایران در سال ۲۰۰۵ بعد از سالها به عنوان عضو ناظر سازمان تجارت جهانی (*WTO*) پذیرفته شد و برای پیوستن به این سازمان ایران باید شرایط لازم را کسب و احراز نماید. یکی از این شرایط، آزاد سازی بازارهای مالی می باشد، موانع از یک سو و مشوقها از سویی دیگر تأثیر بسزایی در شکل گیری بازارهای مالی دارد. این پیوستن و آزاد سازی بازارهای مالی در اندازه و نقش دولت و شکوفایی اقتصادی تأثیر بسزایی دارد. علیرغم اهمیت این موضوع تا بحال به تأثیر جهانی شدن و

آزاد سازی مالی بر اندازه دولت پرداخته نشده است. در بحث جهانی شدن مطالعات زیادی صورت پذیرفته است اما تا بحال تنها جنبه های صنعتی و یا یک صنعت خاص و یا واردات و صادرات مورد توجه قرار گرفته است.

۱-۳-اهداف تحقیق

در این تحقیق با تأثیر جهانی شدن و آزاد سازی مالی بر اندازه دولت ایران از سال ۱۳۸۶ - ۱۳۳۸ پرداخته شده است که می خواهیم به اهداف زیر دست یابیم:

- بررسی ارتباط جهانی شدن و بازارهای مالی در ایران
- تحلیل نقش جهانی شدن در اندازه دولت
- عوامل مؤثر بر جذب سرمایه گذاری مستقیم خارجی
- تأثیر سرمایه گذاری مستقیم خارجی بر سرمایه گذاری مستقیم داخلی
- نقش دولت در ایجاد انگیزه برای سرمایه گذاری خارجی

۱-۴-فرضیات تحقیق

این تحقیق دارای یک فرض اصلی و یک فرض فرعی می باشد که عبارتند از:

اصلی: با جهانی شدن تجارت و آزاد سازی بازارهای مالی اندازه دولت کوچکتر شده است.

فرعی: جهانی شدن باعث افزایش سرمایه گذاری خارجی شده است.

۱-۵-روش انجام تحقیق

روش الگو سازی که به منظور بررسی تأثیر جهانی شدن تجارت بر اندازه دولت به کار گرفته شده است، روش سری زمانی است. در این پژوهش در جهت بررسی تأثیر جهانی شدن و آزاد سازی مالی بر اندازه دولت در ایران برای دوره زمانی ۱۳۸۶ - ۱۳۳۸ با استفاده از رهیافت خود رگرسیون برداری (VAR) به بررسی این موضوع خواهیم پرداخت. باید توجه داشت اولاً داده ها سری زمانی و برای دوره ۱۳۸۶ - ۱۳۳۸ می باشد. ثانیاً داده های مربوط به متغیرهای الگو از حساب ملی و ترازنامه بانک مرکزی جمع آوری شده است.

در تحقیق با استفاده از نرم افزار *Eviews5* به تخمین مدل پرداخته خواهد شد.

فصل دوم

پیشینه نظری و ادبیات موضوع

مقدمه

جهانی شدن پدیده ای است که بروز آن در عصر حاضر موجب تغییر و تحولات زیادی در جنبه های مختلف شده است.

در حال حاضر ادغام تجارت در اقتصاد جهانی امری اجتناب ناپذیر شده است. از یک سو گسترش دامنه احتیاجات و از سوی دیگر تخصصی شدن تولید باعث شده تا هیچ کشوری از سایر کشورها بی نیاز نباشد. در این فصل نخست به تعریف جهانی شدن، سابقه تاریخی جهانی شدن، اثرات جهانی شدن، ابزارها و ویژگیهای جهانی شدن و نظرات و تئوری های مختلف جهانی شدن می پردازیم. سپس مفهوم اندازه دولت و تئوری های مختلف در زمینه اندازه دولت را بررسی می کنیم. در ادامه سرمایه گذاری خارجی و اشکال مختلف سرمایه گذاری خارجی مورد بررسی قرار می گیرد. در انتهای فصل حاضر به مرور مطالعات انجام شده و پژوهش های تجربی در زمینه جهانی شدن، اندازه دولت و سرمایه گذاری خارجی پرداخته خواهد شد.

۲-۱- مفهوم جهانی شدن

نخستین سوالی که باید برای پاسخگویی به آن تلاش می کنیم شناخت ماهیت جهانی شدن است. معنای حقیقی جهانی شدن چیست؟ تا کنون تعریف روشنی از «جهانی شدن» ارائه نشده است؛ زیرا این پدیده به حد نهایی تکامل خود نرسیده و همچنان دستخوش تحول است و هر روز وجه تازه ای از ابعاد گوناگون آن مشخص و نمایان می شود. در این قسمت از پژوهش به تعدادی از تعاریف جهانی شدن اشاره می کنیم: آنتونی گیدز جهانی شدن را فشردگی روابط اجتماعی به نحوی (می داند) که مکان های دور را چنان بهم می پیوندد که اتفاقاتی که در فواصلی بسیار دور از دسترس رخ داده باعث شکل گیری رخ دادهای محلی نیز می شود. [۲]

کروگمن و رنه بالمز جهانی شدن را ادغام بیشتر بازارهای جهانی تعریف کردند. پروفیسور کول با بهره گیری از تعریف «سازمان همکاری و توسعه اقتصادی» (OECD) جهانی شدن را الگوی تکامل یابنده ای از فعالیت های فرامرزی بنگاه ها و شرکت ها تعریف می کند که شامل سرمایه گذاری بین المللی، تجارت و همکاری برای ابداع و نوآوری و توسعه فرآورده های تازه و نو، تولید، منبع شناسی و بازاریابی است. [۳]

جهانی شدن اقتصاد را می توان «شرایطی که در آن حد و مرزهای جغرافیایی در فعالیت های اقتصادی از قبیل، سرمایه گذاری و تولید و نقل و انتقالات مالی کمترین نقش را داراست» تعریف کرد. (با جهانی شدن اقتصاد، اقتصاد کشورهای جهان به شدت به هم وابسته می شود، موانع گمرکی و تجاری به حداقل کاهش می یابد و نقل و انتقالات مالی بین کشورها به آسانی میسر می گردد.) [۴]

به نظر مک ایوان^۱، روند جهانی شدن اقتصاد به سوی توسعه و توزیع گسترده تر، آزاد و بین المللی و البته بدون حد و مرز و روابط و مبادلات تجاری و اقتصادی می باشد. [۴]

نوازش علی^۲ در تعریف جهانی شدن اقتصاد بیان می دارد که جهانی شدن اقتصاد، به رشد وابستگی اقتصادی بین کشورها در سطح جهان و افزایش حجم و نوع مبادلات مرزی کالا و خدمات و افزایش جریان سریع بین المللی و همچنین تسریع انتقال تکنولوژی اشاره دارد. [۵]

صندوق بین المللی پول جهانی شدن را ادغام وسیع تر و عمیق تر تعریف می کند. به عبارت دیگر جهانی شدن را رشد و وابستگی متقابل کشورها در سراسر جهان از طریق افزایش حجم و تنوع مبادلات کالا و خدمات و جریان سرمایه در ماورای مرزها و همچنین از طریق پخش گسترده و وسیع تر تکنولوژی می داند. [۶]

جهانی شدن اقتصاد را می توان به معنای گشوده شدن مرزها، توسعه تجارت و سرعت بخشیدن به تحولات تکنولوژیک در جهت بهره وری هر چه بیشتر اقتصادی دانست. [۶]

پروفسور لستر تارو در کتاب آینده سرمایه داری می گوید که «اقتصادی جهانی بنا به تعریف، اقتصاد است که در آن عوامل تولید، منابع تولید، منابع طبیعی، سرمایه دانش فنی، نیروی کار و نیز کالاها و خدمات در جهان جا به جا می شوند.» [۳]

جان آرت شلوت جهانی شدن را اشاره به فرآیندهایی می داند که طی آن ارتباطات اجتماعی کم و بیش ویژگی بی فاصله و بی مرز را می یابند. [۲]

۲-۱-۲- سابقه تاریخی جهانی شدن

افت نرخ رشد اقتصاد در دهه ۱۹۷۰ منجر بدان گشت که شرکت های بزرگ در جستجوی بازارهای نو برآیند و نیز تحولات فن آوری و انقلاب انفورماتیک زمینه ساز بروز فرآیند جهانی شدن اقتصاد شدند. مفهوم جهانی شدن از اوایل دهه ۱۹۸۰ به بعد متداول شد و در دهه ۱۹۹۰ ظهور و بروز عینی تری پیدا کرد. [۲]

پایان جنگ سرد و فروپاشی اتحاد جماهیر شوروی سابق در تشدید روند جهانی شدن نقش اساسی داشت و زمینه های بسط و گسترش وجوه مختلف آن را بیش از پیش فراهم ساخت.

۱-A. Macewan

۲-Navazesh. Ali