

درآمدهای نفتی و اقتصاد ایران

نویسندگان :

غلامرضا طراوتی مسرور

(کارشناس ارشد اقتصاد انرژی از دانشگاه علوم و تحقیقات تهران)

بابک محبوبی

(کارشناس ارشد علوم اقتصادی از دانشگاه پیام نور کرج)

درآمدهای نفتی و اقتصاد ایران

نویسندگان: غلامرضا طرواتی مسرور

چاپ : اول

بایک معیوبی

ناشر: انتشارات آمار

کیراژ: ۱۰۰۰

چاپ: چاپ اول

قیمت: ۱۰۰۰۰ تومان

کلیه حقوق مادی و معنوی این اثر متعلق به ناشر است



تشر آيار aparyub

www.aparpub.ir www.aparpub@yahoo.com www.info@aparpub.ir

[illegible]

میدان بسیج، بلوار قصر فیروزه، کوچه

نجف زاده، یلاکی - ۸۰، همکف.

تلفون: ۰۹۴۲ ۶۴ ۲۸ ۲۷۰

• 332 202 TA 77

No80.Njafzadeh Alley

.Ghasre Firoozeh BLV

Basij Sq.Tehran.Iran

Tel. +989336438370

+989123593862

فهرست مطالب

صفحه

عنوان

۹	پیشگفتار
---	----------

فصل اول : مقدمه و کلیات

۱۱	۱-۱ بیان مسأله
۱۳	۲-۱ اهداف تحقیق
۱۳	۳-۱ ضرورت و اهمیت تحقیق
۱۵	۴-۱ سوالات تحقیق
۱۵	۵-۱ فرضیات تحقیق
۱۵	۶-۱ مدل تحقیق
۱۶	۷-۱ روش تحقیق و منابع آماری
۱۶	۸-۱ قلمرو تحقیق و جامعه آماری
۱۶	۹-۱ تعاریف عملیاتی واژگان کلیدی
۱۶	۱-۹-۱ تعاریف عملیاتی متغیرها

فصل دوم : مروری بر ادبیات موضوع تحقیق

۱۹	۱-۲ نفت و تاثیر آن بر اقتصاد کشورها
۱۹	۱-۱-۲ ۱- تاریخچه بروز شوک‌های نفتی
۲۰	۱-۱-۲ ۱- شوک اول نفتی که تقارن دارد با جنگ یوم کیپور
۲۱	۱-۱-۲ ۲- شوک دوم نفتی (بروز جنگ تحمیلی عراق به ایران)
۲۲	۱-۱-۲ ۳- شوک سوم نفتی (شکست اوپک در کنترل قیمت‌ها)
۲۴	۱-۱-۲ ۴- روند صعودی قیمت‌های نفت از سال ۲۰۰۲
۲۵	۱-۱-۲ ۲- تاثیر نوسانات قیمت نفت بر اقتصاد کشورهای صادرکننده نفت
۲۵	۱-۲-۱ ۱- بیماری هلندی
۳۰	۱-۲-۱ ۲- مکانیسم تاثیر درآمدهای نفتی بر تولید ناخالص داخلی
۳۲	۱-۲-۱ ۳- بررسی تاثیر درآمدهای نفتی بر تراز پرداخت ها
۳۵	۱-۲-۱ ۴- بررسی تاثیر درآمدهای نفتی بر کسری بودجه دولتی
۳۶	۱-۲-۱ ۵- بررسی تاثیر درآمدهای نفتی بر میزان سرمایه گذاری
۴۱	۱-۲-۱ ۶- بررسی تاثیر درآمدهای نفتی بر قیمت‌های داخلی

فصل سوم : مروری بر ادبیات تجربی موضوع تحقیق

۴۷	۱-۳ مطالعات خارجی
۴۷	۱-۱-۳ مطالعه همیلتون
۴۹	۲-۱-۳ مطالعه باریج و هاریسون
۴۹	۳-۱-۳ مطالعه گودوین
۵۰	۴-۱-۳ مطالعه یاپایترو
۵۰	۵-۱-۳ مطالعه میورونویچ
۵۱	۶-۱-۳ مطالعه رایونتاوا
۵۱	۷-۱-۳ مطالعه فردمنش
۵۲	۸-۱-۳ مطالعه اوز تورک و همکاران
۵۳	۹-۱-۳ عبدالعزیز و همکارانش
۵۴	۲-۳ مطالعات داخلی
۵۴	۱-۲-۳ مطالعه سامتی و همکاران
۵۵	۲-۲-۳ مطالعه جرجرزاده و اقبالی
۵۶	۳-۲-۳ عباسیان و همکاران
۵۸	۴-۲-۳ مطالعه توسلی و فولادی
۵۹	۵-۲-۳ مطالعه پاسبان
۵۹	۶-۲-۳ مطالعه ختایی و همکاران

فصل چهارم : تصریح، تخمین و آزمون الگو

۶۷	۱-۴ روش تخمین الگو
۶۸	۱-۱-۴ معادلات همزمان
۷۰	روش حداقل مربعات معمولی (OLS)
۷۱	حداقل مربعات غیرمستقیم (ILS)
۷۱	حداقل مربعات دومرحله ای (2SLS)
۷۳	حداقل مربعات سه مرحله ای (3SLS)
۷۳	۲-۴ تصریح الگو
۷۷	۱-۲-۴ تشریح معادلات الگو
۷۷	۱-۱-۲-۴ معادله مخارج کل:
۷۸	۲-۱-۲-۴ معادله سطح عمومی قیمت ها
۸۰	۳-۱-۲-۴ معادله صادرات غیرنفتی

۸۲	۴-۲-۱-۴ معادله واردات
۸۵	۴-۲-۱-۵ معادله سرمایه گذاری
۸۶	۴-۲-۱-۶ معادله کسری بودجه دولتی
۸۷	۴-۲-۳ برآورد الگو و ارزیابی نتایج
۸۷	۴-۲-۱ الگوی برآورد شده
۹۲	۴-۲ تجزیه و تحلیل نتایج
۹۳	۴-۲-۱ معادله تولید ناخالص داخلی حقیقی
۹۴	۴-۲-۲ معادله سطح قیمت‌های داخلی
۹۴	۴-۲-۳ معادله صادرات غیرنفتی
۹۵	۴-۲-۴ معادله واردات
۹۶	۴-۲-۵ معادله سرمایه گذاری
۹۷	۴-۲-۶ معادله کسری بودجه دولتی
۹۷	۴-۵ بررسی روند زمانی متغیرهای بکار گرفته شده در الگو
۱۰۳	۴-۶ تعیین اعتبار الگو
۱۰۴	۴-۶-۱ آزمون انطباقی
۱۰۴	۴-۶-۱-۱ مقایسه نمودار شبیه سازی و تاریخی
۱۰۸	۴-۶-۲ تجزیه و تحلیل خطا
۱۱۰	۴-۶-۲ آزمون تعیین حساسیت الگو نسبت به زمان شروع شبیه سازی
۱۱۳	۴-۶-۳ آزمون پایداری الگو
۱۱۸	۴-۷ شبیه سازی

فصل پنجم : نتیجه گیری و پیشنهادات

۱۲۳	۵-۱ نتایج تحقیق
۱۲۵	۵-۲ پیشنهادات و توصیه‌های سیاستی
۱۲۹	پیوست
۱۲۹	پیوست ۱- نظام‌های ارزی
۱۲۹	نظام نرخ ارز ثابت
۱۳۰	نظام نرخ ارز شناور (نرخ ارز انعطاف پذیر)
۱۳۵	پیوست ۲- نرخ ارز حقیقی داخلی - سه کالایی
۱۳۵	پیوست ۳- نحوه بدست آوردن معادله قیمت
۱۳۸	پیوست ۴- روش‌های حل الگو
۱۴۱	پیوست ۵- نتایج بدست آمده از تخمین الگو در نرم افزار
۱۴۱	نتایج آزمون دیکی فولر سطح متغیر سطح عمومی قیمت ها

۱۴۲	نتایج آزمون دیکی فولر سطح متغیر سرمایه گذاری
۱۴۳	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر تولید ناخالص داخلی مرتبه اول
۱۴۴	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر حجم نقدینگی مرتبه اول
۱۴۵	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر درآمدهای نفتی (لگاریتمی) مرتبه اول
۱۴۶	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر هزینه‌های دولتی (لگاریتمی) مرتبه اول
۱۴۷	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر نرخ ارز حقیقی مرتبه اول
۱۴۸	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر صادرات غیرنفتی مرتبه اول
۱۴۹	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر رابطه مبادله مرتبه اول
۱۵۰	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر ضریب بسته بودن اقتصاد مرتبه اول
۱۵۱	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر سنجه رقابت پذیری مرتبه اول
۱۵۲	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر بهره وری مرتبه اول
۱۵۳	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر وضعیت اقتصادی دولت مرتبه اول
۱۵۴	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر هزینه‌های دولتی مرتبه اول
۱۵۵	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر درآمدهای نفتی مرتبه اول
۱۵۶	نتایج آزمون دیکی فولر متغیر درآمدهای غیرنفتی مرتبه اول
۱۵۷	کتابنامه

بسم الله الرحمن الرحيم

العلم و الدين توأمان اذا افترقا احترقا (امام جعفر صادق (ع))

پیشگفتار

نفت خام به عنوان یکی از منابع غنی (و تا کنون کم رقیب) تامین انرژی، از اهمیت به سزایی در صحنه اقتصاد جهانی برخوردار است. تغییرات قیمتی و نیز تغییر در میزان عرضه و تقاضای این ماده حیاتی تاثیر بسیار زیادی بر اقتصاد کشورها دارد و در این گذار بیشترین تاثیرپذیری مربوط به کشورهای صادرکننده و کشورهای مصرف کننده عمده نفت خام می باشد. اقتصاد ایران به عنوان کشوری که بخش اعظمی از درآمدهای دولتی از محل صادرات این ماده به دست می آید به شدت تحت تاثیر تغییرات قیمتی و درآمدهای حاصل از صادرات نفت خام می باشد. این تاثیر را می توان در بودجه، هزینه کرد بخش دولتی و رفتارهای بخش های مرتبط با این حوزه به روشنی مشاهده نمود. ایران به عنوان اقتصادی تک محصولی و وابستگی بالا به درآمدهای نفتی با نفت گره خورده و عجین است. اما آیا درآمدهای حاصل از منابع طبیعی همیشه حامل خیر و برکت هستند؟ پاسخ این سوال را می توان در مطالعه تاریخ اقتصادی کشورهای صادرکننده منابع طبیعی جستجو کرد. تجربه هلند می تواند موردی روشنگر در مسیر مطالعاتی در این حوزه قلمداد گردد. با توجه به وابستگی زیاد اقتصاد ایران به درآمدهای نفتی بررسی چندجانبه و تحلیل فرایند تاثیر این درآمدها بر بخش ها و متغیرهای اساسی اقتصاد از اهمیت بالایی برخوردار است. این ضرورت این محققان را بر آن داشت تا مطالعه حاضر را با تکیه بر مدل های علمی و قابل راستی آزمایی به رشته تحریر درآوریم. در این مسیر از





محضر اساتید بزرگواری چون جناب آقای دکتر مجید احمدیان و جناب آقای دکتر محمدرضا رنجبر فلاح بهره جستیم. مطالعه حاضر با عنوان درآمدهای نفتی و اقتصاد ایران حاصل مطالعات و پژوهش های محققان در مقطع کارشناسی ارشد می باشد و بی شک خالی از نقص نیست. بدین وسیله از صاحب نظران، پژوهشگران، اساتید و دانشجویان گرامی خواهشمندیم نظرات، پیشنهادها و انتقادات خود را در این زمینه با اینجانبان در میان بگذارند. بی شک رهنمودهای شما بزرگواران راهنما و راهگشای ما در ادامه مسیر خواهد بود.

مقتضی است در این مقال از زحمات بی حساب پدر و مادرانمان، راهنمایی های گرانقدر اساتید و دوستانمان و از حمایت های بی دریغ همسرانمان همچنین از دوستان گرامی که ما را در گام نهادن در این مسیر تشویق نمودند، کمال تشکر و قدردانی را داشته باشیم. از جناب آقای دکتر محمدی و سرکار خانم محمدی که ما را در امر تایپ، چاپ و نشر این کتاب یاری نمودند، تشکر می نماییم.

غلامرضا طراوتی مسرور

(کارشناس ارشد اقتصاد انرژی دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم تحقیقات)

بابک محبوبی

(کارشناس ارشد علوم اقتصادی دانشگاه پیام نور کرج)

