



تصریح یک مدل کلان برای اقتصاد ایران با تأکید بر درآمدهای نفتی و اشتغال

سید کمیل طیبی

دانشیار اقتصاد، دانشگاه اصفهان،

komail@econ.ui.ac.ir

افسانه بهرامی

دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی واحد خمینی شهر،

afsanehbahrami_2002@yahoo.com

چکیده

در اقتصادهای تک محصولی به ویژه اقتصادهای تولید کننده و صادر کننده نفت نگرانی و دغدغه اصلی بر مضمولیت آثار ناشی از شوک و نوسانهای یک بخش اقتصادی بر شاخصهای کلان اقتصادی و سپس ایجاد اختلال در فعالیت‌های خرد است. بدین لحاظ هدف این مطالعه ارزیابی اثرات ناشی از افزایش درآمدهای نفتی بادآورده و بدنبال آن وقوع کسری بودجه دولت ناشی از تمایل به افزایش مخارج دولتی نسبت به درآمدهای غیر نفتی بر سطح اشتغال و سایر شاخصهای کلان اقتصادی در یک دوره‌ی زمانی (۸۴-۱۳۳۹) بوده است.

از آن جایی که افزایش درآمدهای نفتی ممکن است متغیرهای تورم، نقدینگی و رشد اقتصادی را نیز دامنگیر نماید، یک مدل سیستمی اقتصاد کلان شامل معادلات همزمان تصریح شده‌است که این معادلات با استفاده از داده‌های سری‌های زمانی اقتصاد کشور به روش دو مرحله‌ای حداقل مربعات (2SLS) برای دوره زمانی مذکور برآورد شده‌اند.

نتایج تجربی بدست آمده حکایت از ناکارآمدی درآمدهای ناشی از صادرات نفت بر سطح اشتغال کشور دارند. همچنین در شرایطی که این درآمدها افزایش چشمگیری داشته و معضلات رشد نقدینگی و افزایش کسری بودجه‌ی دولت را در پی داشته‌اند، کاهش در سطح اشتغال و تعدیل فرصت‌های شغلی را در کشور تحمیل نموده‌اند. در مقابل همزمان با رشد صادرات غیر نفتی از طریق گرایش بیشتر به بازار و تقویت بخش خصوصی نشانه‌های افزایش اشتغال پدیدار گشته است.

واژه‌های کلیدی: درآمدهای نفتی، کسری بودجه دولت، اشتغال، اقتصاد کلان ایران، سیستم معادلات همزمان.



۱- مقدمه

در نظامهای مختلف اقتصادی، بخش مهمی از وظایف دولتها از طریق بودجه به اجرا گذاشته می شود. ایجاد زمینه مناسب برای رشد و توسعه با ثبات، ارائه کالاها و خدمات عمومی، بهبود توزیع درآمد، تأمین عدالت اجتماعی و در نهایت مهار نوسانهای اقتصادی از مهمترین وظایف دولتها به شمار می رود و در این نظامها برای انجام امور فوق از ابزار بودجه استفاده می شود.

همچنین دولتها با استفاده از این ابزار و سیاستگذاریهای مالی و پولی مربوط به آن تلاش می نمایند تا با ایجاد سرمایه گذاریهای زیر بنایی در صنایع مادر و سرمایه بر، توسعه فن آوری، تولید و توزیع کالاها و خدمات (از طریق استخدام عوامل تولید و مدیریت)، انجام هزینه های مستقیم و غیر مستقیم مثل خرید کالاها و خدمات، اعطای وامهای ارزان، سهمیه ارزی و کمکهای مالی، مقابله با بحرانهای اقتصادی، بنیانهای رشد و توسعه اقتصادی را تثبیت نمایند.

در صورتی که فرآیند تهیه و تدوین بودجه نظام اجرایی و روش نظارت و کنترل بر آن از کارایی لازم برخوردار باشد، امکان اجرای بهتر وظایف محول شده برای دولت ایجاد می گردد. از طرف دیگر، در بسیاری از کشورهای در حال توسعه از جمله کشور ما عملکرد بخش خصوصی ضعیف بوده، درحالی که حیطة فعالیت دولتها بسیار گسترده است. پس تصور عمومی بر اینست که با افزایش منابع هزینه های دولت می توان باعث فزونی اشتغال، کاهش نرخ بیکاری و افزایش درآمد ملی گردید. علاوه بر این هر گونه تغییر در منابع نفتی که قسمت عمده ای منابع دولتی را تشکیل می دهد، شاخص های اشتغال و رشد را تحت تأثیر قرار می دهد و بر نرخ رشد تورم تغییرات زیادی را ایجاد می کند.

دیدگاههای فوق از یک سو و وجود درآمدهای سرشار نفتی که دخل و خرج آنها همواره دولت بر عهده داشته است، و همچنین افزایش قیمت جهانی نفت و رشد فزاینده قیمت ها طی سال های اخیر، درآمدهای ارزی حاصل از فروش نفت را در کشورمان افزایش داده است. تأثیر این درآمدها بر رشد اقتصادی کشور و چگونگی استفاده از مازاد درآمدهای نفتی، موجب شده دیدگاه های مختلفی در مورد شیوه کنونی به کارگیری این درآمدها و آثار و نتایج آن در اقتصاد مطرح شود. در این مطالعه نقش درآمدهای نفتی و سیاست های دولت در دوره ی (۱۳۸۴-۱۳۳۹) در یک چارچوب اقتصاد کلان به بحث گذاشته می شود.

با این توصیف به بررسی تأثیر گذاری افزایش درآمدهای نفتی بر کسری بودجه دولت و سطح اشتغال در اقتصاد ایران می پردازیم.

به طور کلی هدف این بررسی را می توان یافتن پاسخی برای پرسشهای زیر عنوان کرد:

۱. آیا تغییرات درآمدهای نفتی بر روی کسری بودجه دولت موثر است؟

۲. آیا تغییرات درآمدهای نفتی بر روی سطح اشتغال موثر است؟

۳. آیا سیاست کسری بودجه دولت بر روی سطح اشتغال موثر است؟



این مطالعه در پنج بخش تهیه و تنظیم شده است: بخش دوم شامل مباحث نظری است، بخش سوم به مروری بر ادبیات موضوع می‌پردازد، بخش چهارم شامل ارائه مدل اقتصاد کلان ایران است، در بخش پنجم مدل تصریح شده برآورد و نتایج تجزیه و تحلیل می‌شود و بخش ششم شامل نتیجه گیری و پیشنهادات خواهد بود.

۲- رابطه بین درآمدهای نفتی، مخارج دولت و اشتغال: بحث نظری

یکی از صورت های کلی که اغلب درآمدهای دولت بر مبنای آن طبقه بندی می‌شود، مشتمل بر درآمدهای مالیاتی سایر درآمدها و قرضه است؛ که البته قرضه، در واقع جبران کسری بودجه است، نه یک منبع دائم درآمدی. در عمده‌ی اقتصادها ردیف اول؛ یعنی درآمد های مالیاتی، بخش غالب درآمد ها را تشکیل می دهد. مالیات نه تنها به عنوان یک منبع تأمین مالی قابل اتکا برای دولت‌ها مطرح است، بلکه در صورت لزوم می‌تواند به عنوان یکی از اهرم‌های مؤثر دولت جهت اتخاذ سیاست‌های تثبیتی و توزیع مجدد درآمد با تغییر نرخ مالیاتی مورد استفاده قرار گیرد. درآمدهای غیر مالیاتی دولت از یک سو حجم قابل توجهی از هزینه‌های دولت را پوشش می‌دهد و از سوی دیگر به دلیل آن که بخش عمده آن ماهیتی برون‌زا (نظیر درآمدهای نفتی در ایران) دارد، لذا نوسانات آن به سرعت منجر به نوسانات شدید کسری بودجه دولت می‌شود.

در اقتصاد ایران نیز دولت از منابع مختلفی کسب درآمد می کند، که یکی از منابع اصلی درآمدهای نفتی است. اگرچه درآمدهای نفتی نباید به عنوان یکی از منابع اصلی تأمین هزینه های دولت، به خصوص هزینه‌های مصرفی، مورد اتکا قرار گیرد، اما شواهد نشان می‌دهد که روند مخارج مصرفی دولت هم سو با روند درآمدهای نفتی است، به عبارت دیگر، در زمان افزایش درآمدهای نفتی، مخارج مصرفی دولت نیز افزایش می‌یابد (متوسلی و فولادی ۱۳۸۵).

مخارج دولت نیز به تفکیک شامل مخارج مصرفی دولت بابت خدمات عمومی، مخارج مصرفی دولت بابت بهداشت عمومی، مخارج مصرفی دولت بابت رفاه اجتماعی، مخارج مصرفی دولت بابت خدمات اقتصادی، مخارج مصرفی وزارتخانه‌ها و موسسات وابسته به دولت، مخارج مصرفی دولت بابت تأمین اجتماعی، و سایر مخارج. این مخارج ابزاری است که دولت بوسیله آن‌ها می‌تواند بر رشد اقتصادی تأثیر گذار باشد. با این حال در بررسی نحوه تأثیرگذاری این ابزار سیاستی بر رشد اقتصادی در وهله اول باید توجه نمود که تأمین مالی هر سطحی از مخارج دولت، چه از طریق مالیات یا از طریق استقراض بخش دولتی، منجر به جذب منابع حقیقی بیشتر توسط بخش عمومی می‌شود و از دیدگاه تخصیصی منجر به بروز اثر جانشینی جبری می‌گردد. حال چنانچه مخارج بخش دولتی منجر به افزایش بهره وری بخش خصوصی گردد، آنگاه تحت شرایطی که منفعت اجتماعی این مساله از هزینه فرصت کم شدن منابع در اختیار بخش خصوصی بیشتر باشد، می‌توان گفت که مخارج بخش دولتی تأثیر مثبتی بر رشد اقتصادی بر جای می‌گذارد (شفیعی و همکاران ۱۳۸۳). در مقابل، اگر مخارج بخش دولتی تنها در قالب مخارج مصرفی و غیرمولد صورت پذیرد، آنگاه با توجه به پایین تر بودن کارایی بخش عمومی نسبت به بخش خصوصی می‌توان گفت که سطح تولید به جای افزایش، کاهش نیز خواهد داشت. پس هر قدر مخارج



دولت بیشتر مکمل مخارج بخش خصوصی باشد، رشد اقتصادی بیشتر افزایش می‌یابد، اما هر قدر مخارج دولتی بیشتر جانشین مخارج بخش خصوصی گردد، قضیه عکس خواهد بود. البته به ازای درجه مشخص از جانشینی و مکمل بودن بین مخارج دولتی و بخش خصوصی، تنها تا حد معینی افزایش در رشد اقتصادی آشکار می‌شود و پس از گذار از یک زمان خاص به بعد، این ارتباط منفی نیز خواهد شد. اجزای مخارج مصرفی دولت دارای اثرات متفاوتی بر بهره‌وری و کارایی است. آن دسته از مخارج مصرفی دولت که در راستای ایجاد وظایف سنتی دولت است، منجر به افزایش بهره‌وری و کارایی می‌شود، که این مخارج عمدتاً شامل مخارج مصرفی بابت حفظ نظم و امنیت جامعه و مخارج رفاهی هستند. اما سایر هزینه‌های دولت که مولدیت نداشته‌اند یا مخارجی هستند که بخش خصوصی نیز می‌تواند آن فعالیت‌ها را انجام دهد، دارای اثر منفی بر بهره‌وری خواهد بود (شفیعی و همکاران ۱۳۸۳).

در ایران منابع نفتی یکی از منابع عمده مخارج دولتی است، به طوری که نقش نفت در اقتصاد ایران از دهه ۲۰ نمایان شد. در دهه ۱۳۵۰ به دنبال افزایش قیمت نفت صادراتی و سرازیر شدن درآمدهای آن به کشور، سهم بخش نفت در بودجه‌های دولت به شدت افزایش یافت و صنایع کشور با تکیه بر درآمدهای نفتی شکل گرفت. این فرایند موجب شد که اقتصاد کشور بر پایه درآمدهای بخش نفت شکل بگیرد. البته کاهش درآمدهای نفتی، به دلیل عدم انعطاف پذیری بودجه جاری باعث کاهش اعتبارات پروژه‌های عمرانی و طولانی مدت شدن دوره سرمایه‌گذاری و کاهش تولید می‌شود. از سوی دیگر، کاهش درآمدهای ارزی حاصل از نفت، از طریق کاهش واردات کالاهای واسطه‌ای و سرمایه‌ای بر تولید اثر خواهد گذاشت. بررسی ساختار تجارت خارجی کشور نیز نشان می‌دهد که سهم عمده‌ای از صادرات کالای کشور به صادرات نفت اختصاص دارد (در سال‌های اخیر حدود ۸۲ درصد از صادرات را، نفت تشکیل داده است). از سوی دیگر، واردات واسطه‌ای و سرمایه‌ای به ارز حاصل از صادرات نفت وابستگی زیادی دارد (در سال‌های اخیر واردات واسطه‌ای و سرمایه‌ای در حدود ۸۰ درصد صادرات نفت بوده است).

در اقتصاد ایران دولت همواره مدیریت بخش اعظمی از منابع و فعالیت‌های اقتصادی را به عهده داشته است و از طریق مشارکت مستقیم در تولید یا از طریق سرمایه‌گذاری در زیرساخت‌ها، آموزش و پرورش به صورت غیرمستقیم بر تولید اثر می‌گذارد و سیاست‌های کلان بر فعالیت‌های بخش خصوصی مؤثر بوده است. افزایش قیمت جهانی نفت، یا به عبارت دیگر، افزایش درآمدهای نفتی در اقتصاد ایران، به معنای تزریق وجوه مالی به اقتصاد است. نتایج مطالعات موجود در ادبیات نشان می‌دهد که ارتباط مستقیم و معناداری بین افزایش درآمدهای نفتی و مخارج دولت و خالص صادرات و واردات وجود دارد (متوسلی و فولادی ۱۳۸۵). افزون بر این، افزایش درآمدهای نفتی بر سایر اجزاء تولید ناخالص داخلی، یعنی مصرف بخش خصوصی و تشکیل سرمایه ثابت ناخالص نیز اثر مثبتی دارد. اگرچه این اثر کم‌تر و در سطح پائین‌تری نیز معنادار است اما ممکن است با افزایش قیمت جهانی نفت، مخارج دولت و خالص صادرات و واردات افزایش یابد. هم‌چنین انتظار بر این است که مصرف



بخش خصوصی و تشکیل سرمایه ناخالص ثابت نیز افزایش یابد، هرچند که مقدار افزایش آن‌ها کم تر از افزایش مخارج دولت و خالص صادرات و واردات خواهد بود.

در خصوص سیاست کسری بودجه و تأثیر آن بر متغیرهای اقتصاد کلان عقاید گوناگونی وجود دارد: کینز معتقد است در شرایط رکودی تنها می‌توان از طریق افزایش مخارج دولت تقاضای کل را افزایش داد. بنابراین کسری بودجه به دلیل اثر مثبت بر تقاضای کل اقتصاد مفید است. از نظر طرفداران دیدگاه سنتی، کاهش در مالیاتها باعث افزایش در مصرف جاری خواهد شد، به طوری که بالا رفتن مصرف بر سیستم اقتصادی اثر خواهد گذاشت و در کوتاه مدت افزایش مصرف موجب افزایش تقاضای کل می‌شود. بنابراین سطح تولید و اشتغال افزایش پیدا می‌کند. در مجموع باید گفت استفاده از سیاست کسری بودجه در صورتی می‌تواند به افزایش تولید و رشد اقتصادی کشور کمک کند و دولت را در اجرای برنامه‌های یاری دهد که دولت در توسعه زیر بناهای اقتصادی سرمایه‌گذاری کند.

ریکاردو بر این عقیده بود که افزایش در کسری بودجه ناشی از افزایش در هزینه‌های دولت بوده که به هر حال باید در زمان حال یا بعداً پرداخت شود. بنابراین کاهش مالیاتها که از سیاست کسری بودجه ناشی شده‌است، هیچ اثری بر مصرف و پس‌انداز ندارد و از این طریق سایر متغیرهای اقتصادی از جمله رشد اقتصادی را بدون تغییر باقی می‌گذارد. البته به عقیده طرفداران دیدگاه سنتی مصرف‌کنندگان بر این باورند که مالیاتهای آینده بر میزان مصرف جاری آنها اثرات چندان زیادی ندارند و بنابراین مصرف خود را افزایش می‌دهند و پس‌انداز آنها کاهش می‌یابد و از این طریق بر رشد اقتصادی اثر خواهد گذاشت (صمیمی و همکاران ۱۳۸۵).

با این حال دیدگاه ریکاردو به این معنی نیست که همه تغییرات مالی بر متغیرهای اقتصادی بی‌اثرند، بلکه اگر سیاستهای مالی بر خریدهای حال و آینده دولت اثری داشته باشد، به طور حتم بر میزان مصرف مصرف‌کنندگان تأثیر مثبت، و از این طریق بر سایر متغیرهای اقتصادی اثر خواهد گذاشت. باید توجه داشت که کاهش در خریدهای دولت (نه کاهش در مالیاتها) باعث افزایش مصرف می‌شود. اگر دولت اعلام کند که خریدهای خود را در آینده کاهش می‌دهد، باعث می‌شود که مصرف امروز بالاتر رود، حتی اگر در مالیاتهای کنونی هیچ تغییری داده نشود.

عدم تعریف واحد از کسری بودجه و منابع تأمین آن در قوانین ناظر بر تهیه و تنظیم بودجه در ایران و برنامه‌های توسعه اقتصادی و اجتماعی و تبصره‌های بودجه سنواتی موجب گردیده است تا دستگاه‌های متولی ارائه بودجه در یک دوره معین با یکدیگر تفاوت فاحشی داشته باشند. از نظر حسابداری، بودجه مانند هر تراز دیگری همیشه در تراز است، اما از نظر اقتصادی (طبقه بندی ماهیتی) منابع و مصارف دولت و دسته بندی‌های دو یا چند گانه آنها مفاهیمی مانند کسری بودجه یا مازاد بودجه را خلق می‌کند که می‌توان آنها را از دیدگاه‌های مختلفی تجزیه و تحلیل نمود (صمیمی و همکاران، ۱۳۸۵). بجز سالهای ۷۵-۱۳۷۳ دولت همواره از نظر شکاف میان دریافتها و پرداختها کسری بودجه داشته است. عمده‌ترین دلیل مازاد بودجه دولت در سالهای مورد بحث،



افزایش درآمدهای نفتی بوده که نشانگر وابستگی شدید بودجه کشور به درآمدهای نفتی است که نوسان قیمت نفت در بازارهای جهانی، بودجه دولت را با کسری یا مازاد مواجه می کند .

سیاست کسری بودجه می تواند برای ایجاد اشتغال مولد در بخش دولتی مؤثر واقع شود و برای جلوگیری از عوارض نامطلوب آن اتخاذ سیاستهای مکمل ضروری است. آثار اقتصادی کسری بودجه به چگونگی بوجود آمدن و تأمین مالی آن بستگی دارد. لذا به جهت جلوگیری از تورم، افزایش حجم نقدینگی و دیگر آثار نامطلوب کسری بودجه، اصلاح راههای کسری بودجه ضروری به نظر می رسد و از طرفی با افزایش مخارج از طریق سرمایه گذاری در طرحهای زیر بنایی کشور هم موجب شرکت نیروی فعال بیکار در فرآیند تولید و هم از بار تکفل جامعه کاسته می شود و چون این کسری بودجه با افزایش تولید همراه است از آثار تورمی آن در بلند مدت جلوگیری به عمل می آید. اعمال هر سیاستی توسط دولت، که باعث افزایش توجه سرمایه گذاریها به بخشهای مولد اقتصاد شود، بر کاهش بیکاری در کشور مؤثر است. به عنوان مثال، سیاستهای انقباضی پولی دولت، نه تنها سرمایه گذاریهای داخلی را با مشکل مواجه می سازد بلکه می تواند با ایجاد رکود در کشور باعث تشدید بیکاری نیز شود. افزون بر این، سیاست های پولی که نقدینگی را جذب بخشهای مولد اقتصاد می کند، می تواند تأثیر به سزایی بر ایجاد اشتغال در کشور داشته باشد.

۳- مروری بر مطالعات گذشته

شفیعی و همکاران (۱۳۸۳)، در مطالعه ای با استفاده از روشهای $ARDL^1$ و $VDCF^2$ به این نتایج دست یافتند که، بخش عمده ای از درآمدهای دولت را درآمدهای نفتی تشکیل می دهد و مخارج دولت نیز عمدتاً شامل مخارج جاری است و مخارج عمرانی سهم اندکی از کل هزینه های دولت را به خود اختصاص داده است. به عبارتی این ترکیب درآمدها و مخارج دولت سبب شده تا هر ساله درآمدها براساس پیش بینی های صورت گرفته از قیمت های جهانی نفت، استوار شود و در نتیجه بافت مخارج دولت بر درآمدهای غیر واقعی استوار گردد. حتی این شرایط در صورت عدم تحقق قیمت های جهانی نفت پیش بینی شده، درآمدهای پیش بینی شده دولت نیز محقق نخواهد شد. در این صورت برای کاهش هزینه های دولت، مخارج عمرانی آن متأثر شده و کاهش می یابد. توسلی و فولادی (۱۳۸۵)، به بررسی آثار افزایش قیمت جهانی نفت بر تولید ناخالص داخلی و اشتغال در ایران با استفاده از یک مدل تعادل عمومی محاسبه ای $(CGE)^3$ پرداختند، و در نتیجه دریافتند وابستگی اقتصاد ایران به صادرات نفت و در نتیجه به درآمدهای نفتی را نمی توان رد کرد. ضرائب هم بستگی، بیانگر معناداری هم بستگی تولید ناخالص داخلی، مخارج دولت و خالص صادرات و واردات با درآمدهای نفتی است. در این مقاله، با استفاده از مدل تعادل عمومی ایستا، اثر تغییر ۵۰ درصدی قیمت جهانی نفت بر تولید ناخالص داخلی و اجزاء آن

¹ -Autoregressive Distribution Lags.

² -Variance Decomposition Function.

³ -Computable General Equilibrium.



و بر اشتغال کل و اشتغال در بخش های مختلف اقتصادی بررسی شده است، افزایش قیمت نفت اشتغال کل را افزایش می دهد به طوری که این افزایش ناشی از افزایش اشتغال در بخش های نفت و گاز، ساختمان و خدمات است. همچنین مانی (۱۳۷۷) در مطالعه خود به این نتیجه می رسد که بین کسری بودجه و کسری تراز تجاری در اقتصاد ایران در بلند مدت رابطه وجود دارد. معروف خانی (۱۳۷۷) به بررسی رابطه علت و معلولی میان متغیرهای عرضه پول با تورم و کسری بودجه دولت با تورم می پردازد و نشان می دهد که این رابطه یکطرفه بوده و از سمت عرضه پول و کسری بودجه به سمت تورم رابطه وجود دارد. یعنی اینکه تغییرات عرضه پول و تغییرات کسری بودجه دولت علت تغییرات سطح عمومی قیمتها است. بزعم محمدی (۱۳۷۳) هم، مازاد بودجه دولت تأثیر مثبت و قوی بر مازاد تجارت خارجی داشته و برای بهبود تجارت خارجی، کاهش کسری بودجه دولت و افزایش پس اندازهای داخلی مؤثر هستند.

پارسا (۱۳۷۴) افزایش هزینه های عمرانی (سرمایه گذاری) دولت را موجب تشویق و افزایش سرمایه گذاری بخش خصوصی می داند. بنابراین ترکیب هزینه های دولت دارای اهمیت زیادی است. به نظر وی اگر چه این هزینه ها موجب افزایش تقاضای کل و به تبع آن سطح عمومی قیمتها می گردد ولی همین هزینه ها باعث افزایش سرمایه گذاری بخش خصوصی و در نتیجه ظرفیت تولید و به تبع آن درآمد حقیقی می شود. قطمیری و صمدی (۱۳۷۴) نشان می دهند که اگر کسری بودجه دولت از طریق کاهش اعتبارات اعطایی به بخش خصوصی و یا تعدیل در مخارج دولت و یا از طریق افزایش صادرات تأمین گردد منجر به افزایش مازاد تجاری خواهد شد. شیوا و خیابانی (۱۳۷۵) نیز در مقاله خود ارتباط کسری بودجه دولت و کسری تراز تجاری را مورد بررسی قرار داده اند و نشان داده اند که برخلاف نظر پیروان ریکاردو، ارتباط مثبت و قوی بین این دو وجود دارد و هر عدم تعادلی در وضعیت بودجه دولتی خود منجر به عدم تعادل در تراز تجاری می شود. نهایتاً جعفری صمیمی و همکاران (۱۳۸۵) نشان می دهند که یک رابطه بلند مدت منفی بین کسری بودجه و رشد اقتصادی در ایران وجود دارد، در حالی که یک رابطه مثبت تعادلی بلند مدت میان مخارج عمرانی دولت با رشد اقتصادی قابل مشاهده است.

دارات^۴ (۱۹۸۸) یک رابطه دو طرفه بین کسری بودجه و کسری تراز تجاری قائل است. اندرز و لی^۵، (۱۹۹۰)، با بهره گیری از فرضیه هم ارزی ریکاردو و استفاده از مدل خرد اقتصادی به بررسی رابطه بین کسری بودجه و کسری تراز تجاری می پردازند و نتیجه می گیرند که کسری بودجه دولت فدرال آمریکا تأثیر بسزایی بر کسری تراز تجاری داشته است. رزنوینگ و تالمن^۶ (۱۹۹۳) نشان می دهند که کسری بودجه دولت باعث افزایش قیمت دلار می گردد و همچنین کسری بودجه دولت به افزایش کسری در تراز تجاری کمک می کند. آلکسوانی^۷ (۲۰۰۱) به بررسی رابطه بین کسری بودجه و کسری تراز تجاری در اقتصاد عربستان سعودی می پردازد. او بیان می کند که درآمدهای نفتی روی درآمدهای دولت و صادرات کالاها و خدمات در این کشور تأثیر می گذارد. بنابراین درآمدهای

⁴ - Darrat (1998).

⁵ -Enders and Lee (1990).

⁶ -Rosenweing and Tallman(1993).

4 -Alkswani (2001).



نفتی نقش مهمی در تراز تجاری و بودجه عمومی دارند. همچنین رابطه تعادلی بلند مدت بین دو کسری تجاری و بودجه وجود دارد و جهت علیت نیز از سمت کسری تراز تجاری به کسری بودجه تعیین می‌گردد. این محقق پیشنهاد می‌دهد چنانچه دولت بخواهد کسری بودجه و کسری تجاری را کاهش دهد، دولت باید شروع به کاهش کسری تراز تجاری نماید. از آنجایی که کسری تراز تجاری وابسته به قیمت نفت است، دولت باید منابع درآمد ملی را متنوع کند. موقعی که درآمدهای نفتی سهم اندکی در درآمد داخلی داشته باشد جهت علیت بین دو کسری معکوس می‌شود و مطابق با نظریه کینز از سمت کسری بودجه به کسری تجاری تغییر می‌یابد. چنری و برونو^۸ (۱۹۶۲) در ارائه مدل شکاف دو وجهی خود بیان می‌کنند که کشورهای در حال توسعه معمولاً محدودیت نیروی کار و یا حتی پس‌انداز داخلی در جهت رشد و توسعه ندارند بلکه بیشترین محدودیت آنها منابع ارزی است که با افزایش صادرات، این مشکل حل می‌شود. پس با افزایش صادرات به منابع ارزی دسترسی پیدا می‌کنند و با انتقال تجهیزات و تکنولوژی سرمایه‌ای باعث رشد و در نتیجه افزایش اشتغال می‌شوند. بالاسا^۹ (۱۹۷۸) نیز نشان می‌دهد که رشد صادرات اثر مثبت بر رشد اقتصادی دارد و سیاست‌های متکی به صادرات در مقایسه با سیاست‌های درونگرا موجب رشد اقتصادی بالاتری می‌شود. خان و خانم^{۱۰} (۱۹۹۷) اثر صادرات را روی اشتغال در ۱۱ بخش پاکستان بررسی کرده و به این نتیجه رسیده‌اند که یک ارتباط قوی بین توسعه صادرات و رشد GDP در پاکستان موجود می‌باشد. نهایتاً افزایش صادرات منجر به افزایش اشتغال در کلیه بخش‌های اقتصادی این کشور می‌شود.

۴- تدوین الگو

معادله‌ی اشتغال:

به منظور بررسی اثر درآمدهای نفتی و کسری بودجه دولت بر سطح اشتغال در ایران، چارچوب کل نظری یک مدل کلان برای اقتصاد ایران تصریح می‌شود. بدین منظور، معادله‌ی اصلی در این سیستم معادله‌ی اشتغال است که با پیروی از مدل جعفری (۱۳۷۹)، به صورت زیر تعریف می‌شود:

$$\ln L = \alpha_0 + \alpha_1 \ln K + \alpha_2 \ln GDP + \alpha_3 \ln X + U_1$$

که در آن اشتغال نیروی کار (L) مورد نیاز یا به تعبیری تقاضای نیروی کار است که از یک تابع تولید کاب داگلاس استخراج شده است:

$$GDP = A L^{\delta_1} K^{\delta_2} X^{\delta_3} e^{\nu_1}$$

^۸-Chenery and Bruno(1962).

^۹- Balassa (1978).

^{۱۰}- Khan and Khanum(1997)



$$\ln GDP = \ln A + \delta_1 \ln l + \delta_2 \ln K + \delta_3 \ln X + V_1$$

چنانچه ملاحظه می‌گردد علاوه بر سرمایه (K) و نیروی کار (L) و درآمدهای ارزی ناشی از صادرات (X) شامل صادرات نفتی (XO) و غیر نفتی (XNO) نیز است. برای گنجاندن متغیر صادرات در تابع تولید کل، توجهات متعددی مطرح شده، ولی آنچه که وجود این متغیر را در تابع تولید کل اقتصاد ایران موجه می‌سازد بر اساس همان نظریه شکاف دو وجهی است. بر اساس این نظریه، علاوه بر نیروی کار و سرمایه، کارکرد بخش عمده‌ای از اقتصاد ما استفاده از ظرفیتهای موجود متکی به میزان دریافتی‌های ارزی است. در سالهای پس از انقلاب کشور ما غالباً از نظر درآمدهای ارزی با محدودیت بسیار زیادی مواجه بوده است. با وجود این که نفت مهمترین منبع تأمین کننده ارز در کشور است ولی به دلیل کاهش میزان صادرات بدلیل فقدان ظرفیت تولید و مصرف فزاینده داخلی ناشی از رشد جمعیت و قیمت نازل حاملهای انرژی در داخل، در سالهای پس از انقلاب اسلامی کماکان مشکل ارزی در بیشتر سالها بصورت حادی وجود داشته و بخش تجارت خارجی از شکاف قابل ملاحظه‌ای برخوردار بوده‌است. این خود آثار منفی روی واردات مواد واسطه‌ای سرمایه‌ای گذاشته است، هر وقت دارایی‌های ارزی ناشی از صادرات افزایش یافته، واردات نیز به تبع آن افزایش یافته‌است، و بالعکس با کاهش صادرات شاهد کاهش واردات مواد واسطه‌ای و تجهیزات سرمایه‌ای بوده‌ایم که این امر در کارکرد اقتصاد تأثیر مستقیم داشته و دارد. علاوه بر آن در صورت کاهش ارزش صادرات درآمدهای ارزی دولت نیز کاهش یافته و در نتیجه هزینه‌های عمرانی و سرمایه‌گذاری کاهش می‌یابد. از طرف دیگر واردات کالاهای سرمایه‌ای و واسطه‌ای نیز کاهش خواهد یافت و در سرمایه‌گذاری بخش خصوصی خلل وارد می‌شود. بنابراین با توجه به درآمدهای ارزی حاصله از صادرات است که واردات مواد اولیه و کالاهای واسطه‌ای و سرمایه‌ای صورت گرفته، و چرخه تولید و نهایتاً سرمایه‌گذاری به حرکت درمی‌آید. لذا میتوان گفت که درآمدهای حاصل از صادرات، علاوه بر عوامل تولیدی نظیر موجودی سرمایه و نیروی کار، یک عامل بسیار مهم در چرخه تولید کشور و شاید کانال مؤثر در رشد GDP بوده‌است (جعفری ۱۳۷۹).

معادله‌ی عرضه صادرات غیر نفتی:

معادله‌ی (۲)، رابطه عرضه‌ی صادرات غیر نفتی است که با پیروی از مدل جعفری (۱۳۷۹) و تابعی از تولید ناخالص داخلی و شاخص نسبی قیمت کالاهای صادراتی تصریح می‌شود، به طوری که GDP متغیر درونزا و شاخص نسبی قیمت کالاهای صادراتی به عنوان یک متغیر برونزا فرض می‌شوند:

$$\ln XNO = \beta_0 + \beta_1 \ln GDP + \beta_2 \ln PXG + U_2$$

این معادله نیز از یک تابع نمایی بصورت زیر به دست آمده است:



$$XNO = ZGDP^{\beta_1} \left[\frac{P_x(\$) \cdot ER}{Pd} \right]^{\beta_2} e^{u_2}$$

به طوری که

$$\ln XNO = \ln Z + \beta_1 \ln GDP + \beta_2 \ln \left[\frac{P_x(\$) \cdot ER}{Pd} \right] + U_2$$

در این رابطه، $P_x(\$)$ بیان کننده قیمت دلاری کالاهای صادراتی است که با پذیرفتن فرض کشور کوچک، بطور برونزا تعیین می شود، ER نرخ ارز است که در طی سالهای مورد مطالعه بصورت دستوری تعیین شده و Pd قیمت کالاهای داخل است. متغیر فوق یعنی شاخص نسبی قیمت کالاهای صادراتی بطور مثبتی بر عرضه صادرات اثر می گذارد. در صورت افزایش قیمت کالاهای صادراتی و ثبات سایر شرایط، سودآوری در بخش صادرات افزایش یافته که نهایتاً منجر به افزایش تولید و عرضه صادرات خواهد شد. در صورتی که قیمت کالاهای صادراتی ثابت فرض شود و قیمت های داخلی افزایش یابد منجر به افزایش هزینه عوامل در صنایع صادراتی و کاهش سودآوری تولیدات صادراتی و نهایتاً کاهش عرضه صادرات می گردد. بنابراین شاخص نسبی قیمت کالاهای صادراتی دارای رابطه مثبت با عرضه صادرات است.

معادله ی مخارج دولت:

معادله ی (۳)، معادله مخارج دولت است که با پیروی از مدل طبیعی (۱۹۹۶)، به صورت زیر تعریف می شود:

$$\ln GE = \gamma_0 + \gamma_1 \ln GE(-1) + \gamma_2 \ln XO + U_3$$

این معادله تابعی از مخارج دولت با یک وقفه، و صادرات نفت است. صادرات نفت به عنوان منبع اصلی درآمدی دولت که تأثیر عمده ای بر شکل گیری بودجه دولت دارد در نظر گرفته شده که یک متغیر برونزا است. همچنین به خاطر چسبندگی مخارج جاری و مصرفی دولت، مخارج دوره قبل نیز به عنوان یک متغیر توضیحی مورد استفاده قرار می گیرد.

معادله ی مصرف خصوصی:

معادله ی (۴) نیز با پیروی از مدل طبیعی (۱۹۹۶)، به صورت زیر تعریف می شود:

$$\ln PCON = \phi_0 + \phi_1 \ln PCON(-1) + \phi_2 \ln GDP + U_4$$

بر اساس نظریه هایی که در زمینه تابع مصرف وجود دارد، عوامل متعددی همچون درآمد، ثروت، سطح عمومی قیمت ها و عادات های مصرفی در تعیین سطح مصرف مؤثر هستند که مهمترین عامل شناخته شده در این زمینه



درآمد قابل تصرف است. در اینجا به خاطر ساده سازی روابط تولید ناخالص داخلی بعنوان متغیر جانشین بکار رفته است که عمدتاً در ادبیات تجربی از آن استفاده می شود. همچنین به خاطر عاداتهای مصرفی خانوارها که در تعیین سطح مصرف کنونی خانوارها مؤثر هستند، مصرف دوره قبل به عنوان یک متغیر توضیحی مورد استفاده قرار می گیرد. بنابراین معادله (۴) که بیان کننده مخارج مصرفی است، تابعی از مخارج مصرفی بخش خصوصی با یک وقفه و GDP است.

معادله ی تورم:

معادله ی (۵)، معادله ی تورم یا لگاریتم تغییرات قیمت داخلی است و به صورت زیر تعریف می گردد:

$$\ln \Delta P_D = v_0 + v_1 \ln \Delta M + v_2 \ln \Delta P_{D-1} + v_3 \Delta DB + U_5$$

که تابعی از تغییرات حجم نقدینگی، تغییرات نرخ تورم با یک دوره وقفه و تغییرات کسری بودجه دولت است. افزایش حجم نقدینگی باعث افزایش تقاضا برای خرید کالا و خدمات می شود و این هنگامی که با افزایش تولید ناخالص داخلی همراه نباشد موجب افزایش تورم خواهد شد و هنگامی که دولت نیز کسری بودجه اش را از طریق استقراض از بانک مرکزی تأمین کند موجب افزایش خالص مطالبات بانک مرکزی از دولت شده و پایه پولی افزایش می یابد، در نتیجه بر حجم پول اثر می گذارد و باعث افزایش تورم می شود.

اتحاد صادرات:

رابطه (۶)، نشان دهنده ی اتحاد صادرات کل است که از مجموع صادرات غیر نفتی و صادرات نفتی شکل می گیرد.

$$X = XO + XNO$$

معادله ی تقاضای واردات:

معادله ی (۷)، تابع تقاضای واردات کل است که با پیروی از مدل طیبی (۱۹۹۶)، به صورت زیر تعریف می شود:

$$\ln IM = \delta_0 + \delta_1 \ln (Pm / Pd) + \delta_2 \ln GDP + \delta_3 \ln ER + \delta_4 \ln IM_{-1} + U_7$$

که در آن Pm/Pd اشاره به قیمت های نسبی داخلی دارد، ER نرخ ارز می باشد. Pd سطح قیمت های داخلی، به عنوان میانگین هندسی از قیمت کالاهای وارداتی Pm و قیمت کالاهای غیر تجاری Pn تعریف می شود:

$$P_{dt} = P_{mt}^{\omega_1} + P_{nt}^{\omega_2} \quad 0 < \omega_1, \omega_2 < 1 \quad \omega_1 + \omega_2 = 1$$



به طوریکه ω_i سهم کالاهای وارداتی در مخارج کل است. واردات تابعی از قیمت‌های نسبی، تولید ناخالص داخلی، نرخ ارز و واردات با یک دوره وقفه زمانی است، زیرا هنگامی که GDP افزایش می‌یابد تقاضا در مورد کالاها و خدمات نیز افزایش می‌یابد، که در نتیجه تقاضا برای واردات نیز افزایش می‌یابد. افزایش نرخ ارز (کاهش ارزش پول داخلی) منجر به این می‌شود که کالاهای داخلی نسبت به کالاهای خارجی ارزانه‌تر شده و در نتیجه واردات کاهش و صادرات افزایش یابد. افزایش تورم نیز باعث می‌شود که کالاهای داخلی نسبت به کالاهای خارجی گرانتر شده و باعث افزایش واردات و کاهش صادرات می‌شود. همچنین افزایش درآمدهای نفتی منجر به افزایش درآمد ملی شده و باعث افزایش واردات می‌گردد.

معادله‌ی کسری بودجه:

معادله (۸)، با استفاده از مدل ذوالنور (۱۳۷۴)، و به شکل زیر آورده شده است:

$$DB = \theta_0 + \theta_1 TB + \theta_2 M + \theta_3 ER + \theta_4 \Delta Pd + \theta_5 XO + \theta_6 R + U_8$$

این معادله بیانگر ارتباط کسری بودجه دولت با تراز تجاری TB، نرخ ارز ER، حجم پول M، تغییرات نرخ تورم ΔPd ، درآمدهای نفتی XO و نرخ بهره R است. تغییر در نرخ بهره از طریق تغییر سپرده‌گذاری اشخاص نزد سیستم بانکی منجر به تغییر ذخایر قانونی نزد بانک مرکزی می‌گردد که این خود باعث تغییر یکی از اقلام بدهی در ترازنامه بانک مرکزی می‌شود. تغییرات پایه پولی بر روی حجم پول اثر گذاشته و تقاضا برای کالاها و خدمات را تحت تأثیر قرار می‌دهد. این افزایش منجر به افزایش واردات شده و نه تنها حساب جاری را تحت تأثیر قرار می‌دهد، بلکه درآمدهای مالیات بر واردات را نیز افزایش داده و بودجه دولت را تحت تأثیر قرار می‌دهد. لذا متغیر نرخ بهره حقیقی به دلیل اثراتی که بر حساب جاری و بودجه دولت دارد وارد مدل گردیده است. تغییرات نرخ ارز و درآمدهای حاصل از فروش نفت و گاز از طریق تأثیر بر واردات منجر به تغییر درآمدهای مالیاتی دولت شده و بر کسری بودجه اثر می‌گذارد. متغیر حجم نقدینگی به دلیل نحوه تأمین کسری بودجه دولت که معمولاً به صورت استقراض از بانک مرکزی بوده این متغیر را تحت تأثیر قرار می‌دهد و وارد مدل شده است.

اتحاد درآمد ملی:

در مجموع رابطه ذیل بیان کننده اتحاد درآمد ملی است که در شرایط متعارف اقتصادی اندازه گیری می‌شود. در این رابطه، CON بیانگر مصرف بخش خصوصی و GE مخارج دولت و X-IM بیانگر خالص صادرات می‌باشد:

$$GDP = CON + GE + (X - IM)$$

رابطه (۱۰) بیان کننده تراز تجاری است:

$$TB = X - IM$$



بدین ترتیب، مدل اقتصاد کلان ایران که در آن به نقش درآمدهای نفتی و سایر عوامل تأثیرگذار بر شاخص های کلان اقتصاد ایران پرداخته است، در فرم یک سیستم همزمان متشکل از معادلات رفتاری و اتحادها در جدول (۱) ارائه می شود. داده های این متغیرها از سایت اینترنتی بانک مرکزی (۱) اتخاذ شده است.

جدول (۱) مدل تصریح شده اقتصاد کلان ایران مبتنی بر سیستم معادلات همزمان^{۱۱}

معادله	نوع	عنوان
$Ln L = \alpha_0 + \alpha_1 Ln K + \alpha_2 Ln GDP + \alpha_3 Ln X + U$	رفتاری	اشتغال
$Ln XNO = \beta_0 + \beta_1 Ln GDP + \beta_2 Ln PXG + U_2$	رفتاری	عرضه صادرات غیر نفتی
$Ln GE = \gamma_0 + \gamma_1 Ln GE(-1) + \gamma_2 Ln XO + U_3$	رفتاری	مخارج دولت
$Ln PCON = \varphi_0 + \varphi_1 Ln PCON(-1) + \varphi_2 Ln GDP + U_4$	رفتاری	مخارج مصرفی خصوصی
$Ln \Delta P_G = v_0 + v_1 Ln \Delta M + v_2 Ln \Delta P_{M-1} + v_3 \Delta DB + U_5$	رفتاری	تغییرات نرخ تورم
$X = XO + XNO$	اتحاد	صادرات کل
$Ln IM = \delta_0 + \delta_1 Ln (PM / PD) + \delta_2 Ln GDP + \delta_3 Ln ER + \delta_4 Ln IM_{-1} + \delta_5 Ln XO + U_7$	رفتاری	تقاضای واردات

^{۱۱} - شناسایی هر یک از معادلات مدل مطابق با شرایط درجهای (Order Condition) و رتبه ای (Rank Condition) صورت گرفته است، به طوری که کلیه معادلات زیاده از حد (Over-identified) تشخیص داده شده و به روش حداقل مربعات دو مرحله ای (2SLS) قابل تخمین هستند.



$$DB = \omega_0 + \omega_1 TB + \omega_2 M + \omega_3 ER + \omega_4 \Delta P_C + \omega_5 XO + \omega_6 R + U_8$$

$$GDP = CON + GE + (X - IM)$$

$$TB = X - IM$$

رفتاری	کسری بودجه
اتحاد	درآمد ملی
اتحاد	تراز تجاری

۵- تجزیه و تحلیل نتایج:

نتایج زیر حاصل تخمین سیستم معادلات همزمان به روش حداقل مربعات دو مرحله‌ای (2SLS) است. به طوریکه جدول (۲) نتایج برآوردی معادله اشتغال، را گزارش می‌کند. با توجه به نتایج به دست آمده می‌توان به تأثیر گذاری صادرات غیر نفتی بر اشتغال پی برد به طوری که هر افزایشی در صادرات غیر نفتی (XNO) موجب ۰/۳ درصد افزایش در اشتغال می‌شود، اما سرمایه (K) ارتباط منفی و معنا داری را با اشتغال نشان می‌دهد و شاید توجیه آن این باشد که حرکت به سمت صادرات بیشتر همواره از بخشهای مدرن و سرمایه بر اقتصاد و به زیان بخش سنتی و کاربر بوده‌است. تولید ناخالص داخلی (gdp) نیز ارتباط مثبت و معنا داری را با اشتغال دارد. به عبارت دیگر، با افزایش رشد تولید ناخالص داخلی اقتصاد ایران شاهد رشدی معادل ۰/۷۸ درصد به طور متوسط بوده است. بعلاوه افزایش در هر کدام از بخشهای مصرف خصوصی، مخارج دولتی یا خالص صادرات باعث افزایش در بخش تولید و در نتیجه افزایش در اشتغال می‌شود، که در اتحاد ۹ مشخص است:

$$GDP = CON + GE + (X - IM)$$

نتیجه اصلی که این معادله به دنبال آن است، نحوه تأثیر گذاری صادرات نفتی بر سطح اشتغال کشور است. همان طور که نتایج نشان می‌دهند به ازای یک درصد افزایش در صادرات نفتی اشتغال معادل ۰/۵۲ درصد کاهش می‌یابد. این نتیجه گویای این واقعیت است که تکیه بر درآمدهای نفتی همواره در اقتصاد ایران منجر به عدم تخصیص بهینه منابع شده‌است که در نهایت منجر به کاهش سرمایه‌گذاری و اشتغال شده‌است. این در حالی است که صادرات غیر نفتی که معمولاً مربوط به بخش‌های واقعی اقتصاد (مثل صنعت، کشاورزی و خدمات) است به رشد اشتغال کمک کرده‌است.

جدول (۲) : نتایج برآوردی معادله اشتغال



همایش ملی افزایش درآمدهای نفتی و ایجاد فرصت های شغلی

بیست و پنجم مهرماه ۱۳۸۷ - دانشگاه آزاد اسلامی واحد خمینی شهر

Source	SS	df	MS			
Model	2.71126145	4	.677815363	Number of obs =	36	
Residual	.216807684	31	.006993796	F(4, 31) =	97.61	
Total	2.92806914	35	.083659118	Prob > F =	0.0000	
				R-squared =	0.9260	
				Adj R-squared =	0.9164	
				Root MSE =	.08363	

	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
l11						
lxno	.309875	.1079213	2.87	0.007	.089768	.5299819
lgdp	.784007	.0972713	8.06	0.000	.585621	.9823931
lkr	-.1692827	.0624445	-2.71	0.011	-.2966391	-.0419263
lxo	-.5279104	.1135561	-4.65	0.000	-.7595096	-.2963112
_cons	8.912355	.6047518	14.74	0.000	7.678956	10.14575

جدول (۳) نتایج تجربی مربوط به معادله رگرسیونی صادرات غیر نفتی را گزارش می‌کند. در معادله دوم gdp تأثیر مثبت بر روی صادرات غیر نفتی دارد و نرخ ارز نیز اثر مثبت بر روی صادرات غیر نفتی نشان می‌دهد. ذکر این نکته نیز لازم است که به دلیل وجود هم خطی بین نرخ ارز و شاخص قیمت صادرات از وارد کردن متغیر قیمت در برآورد مدل خودداری شده‌است.

جدول (۳) : نتایج برآوردی معادله صادرات غیر نفتی

Source	SS	df	MS			
Model	21.3224805	2	10.6612403	Number of obs =	31	
Residual	7.63354764	28	.272626701	F(2, 28) =	38.32	
Total	28.9560281	30	.965200938	Prob > F =	0.0000	
				R-squared =	0.7364	
				Adj R-squared =	0.7175	
				Root MSE =	.52214	

	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
lnoilexpt						
lgdp	1.859781	1.090014	1.71	0.099	-.3730112	4.092573
ler	.2682018	.137637	1.95	0.061	-.0137349	.5501385
_cons	-17.30593	12.796	-1.35	0.187	-43.51734	8.905484

Instrumented: lgdp
 Instruments: ler L.lge L.lpcon ldm L.lim lir loilexport d81

جدول (۴) تأثیر متغیرهای مختلف را بر روی مخارج دولت نشان می‌دهد. در معادله مخارج عمومی دولت، مخارج دوره قبل تأثیر زیادی بر مخارج دوره جاری دارد، و صادرات نفتی نیز تأثیر مثبت و معناداری را بر مخارج دولتی نشان می‌دهد. جدول (۴) این نتایج بیانگر تابعیت وابستگی اقتصاد بخش عمومی از بخش نفت و گاز است.

جدول (۴) : نتایج برآوردی معادله مخارج دولت



Source	SS	df	MS			
Model	.735173212	2	.367586606	Number of obs =	33	
Residual	.243614374	30	.008120479	F(2, 30) =	45.27	
Total	.978787586	32	.030587112	Prob > F =	0.0000	
				R-squared =	0.7511	
				Adj R-squared =	0.7345	
				Root MSE =	.09011	

	lge	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
lge							
Li.		.6483348	.0845569	7.67	0.000	.4756465	.821023
loilexport		.1086585	.0345389	3.15	0.004	.0381206	.1791963
_cons		2.689815	.8608789	3.12	0.004	.9316652	4.447964

Instrumented:
Instruments:

جدول (۵) اشاره به نتایج برآوردی معادله مصرفی خصوصی به روش 2SLS دارد. در معادله مخارج مصرفی بخش خصوصی، مخارج مصرفی یک دوره قبل بر روی مخارج دوره جاری تأثیر مثبت و معنی دار داشته است. علاوه بر این، متغیر gdp که بیانگر اندازه اقتصادی کشور است، دارای اثر مثبت و معنی داری بر مخارج مصرفی و بخش خصوصی است.

جدول (۵): نتایج برآوردی معادله مخارج مصرفی خصوصی

Source	SS	df	MS			
Model	2.4792793	2	1.23963965	Number of obs =	31	
Residual	.077455288	28	.00276626	F(2, 28) =	447.93	
Total	2.55673458	30	.085224486	Prob > F =	0.0000	
				R-squared =	0.9697	
				Adj R-squared =	0.9675	
				Root MSE =	.0526	

	lpcon	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
lgdp		.3050872	.073383	4.16	0.000	.1547688	.4554055
lpcon							
Li.		.7423033	.0493308	15.05	0.000	.6412538	.8433529
_cons		-.7346608	.5784572	-1.27	0.215	-1.919577	.4502551

Instrumented: lgdp
Instruments: L.lpcon ldm L.lge L.lim lir d81 loilexport

جدول (۶) نتایج برآوردی معادله نرخ تورم را گزارش می کند. مطابق با نتایج کسب شده، اگر چه ارتباط منفی بین کسری بودجه و تورم مشاهده می شود اما به لحاظ آماری معنی دار نیست، که بر خلاف انتظار نظری و تجربی در اقتصاد ایران است با این حال، تغییرات حجم پول اثر مثبت و معنی داری بر روی تورم نشان می دهد که نرخ تورم



دوره قبل دارای تأثیر مثبت بر روی تورم دوره جاری بوده است. بنابراین می توان استدلال نمود که حتی کسری بودجه دولت که اغلب از طریق استقراض از بانک مرکزی شکل گرفته و منجر به رشد نقدینگی شده است، آثار تورمی به دنبال داشته است.

جدول (۶) : نتایج برآوردی معادله نرخ تورم

Source	SS	df	MS			
Model	73.2105812	3	24.4035271	Number of obs =	28	
Residual	4.7538864	24	.1980786	F(3, 24) =	123.15	
Total	77.9644676	27	2.88757288	Prob > F =	0.0000	
				R-squared =	0.9390	
				Adj R-squared =	0.9314	
				Root MSE =	.44506	

	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
ldpd						
ddb	-1.11e-06	8.80e-06	-0.13	0.901	-.0000193	.000017
ldm	.4826885	.2017347	2.39	0.025	.0663285	.8990485
ldpd						
L1.	.4865302	.1900856	2.56	0.017	.0942128	.8788477
_cons	-2.168688	1.068934	-2.03	0.054	-4.374858	.037483

Instrumented: ddb
Instruments: ldm L.ldpd L.lge loilexport ler lim1 lir d81

مطابق با جدول (۷) که نتایج برآوردی معادله واردات کل را نشان می دهد، gdp تأثیر مثبت و معنی داری بر واردات داشته است و همواره رشد اقتصادی کشور منجر به رشد واردات شده است. شاخص قیمت واردات نیز یکی دیگر از عوامل معنی دار با اثر مثبت بر روی واردات مشاهده می شود که البته خلاف انتظار است. دلیل عمده این اثر می تواند با توجه به غیر رقابتی بودن ساختار ویژه بخش واردات ایران باشد که در آن عمده واردات توسط شرکت های دولتی و انحصارگر شکل می گیرد. نرخ ارز اثر منفی و معنی داری را مطابق با انتظار بر تقاضای واردات واردات داشته است. در این راستا اتخاذ سیاست های بهینه ارزی مثل شناور شدن نرخ ارز به رقابتی شدن بخش واردات کمک می کند. همچنین واردات دوره قبل تأثیر مثبت و معنی دار بر روی تقاضای واردات دوره جاری ایجاد می کند که بیانگر رفتار وارداتی کشور با رویکرد تعدیل عدم تعادل در این بخش است.



جدول (۷) : نتایج برآوردی معادله تقاضای واردات

-----				F(4, 23) = 24.59		
Model		2.7208566	4	.680214149	Prob > F	= 0.0000
Residual		.617715921	23	.026857214	R-squared	= 0.8150
-----				Adj R-squared = 0.7828		
Source		SS	df	MS	Number of obs	= 28
Total		3.33857252	27	.123650834	Root MSE	= .16388
-----				-----		
lim		Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]
lgdp		.8363912	.4516292	1.85	0.077	-.0978749 1.770657
lpmd		.573507	.1886638	3.04	0.006	.1832262 .9637878
ler		-.2267067	.0579633	-3.91	0.001	-.3466128 -.1068006
lim						
L1.		.4692921	.1122962	4.18	0.000	.2369898 .7015944
_cons		-2.16556	4.859745	-0.45	0.660	-12.21871 7.887589
-----				-----		
Instrumented: lgdp						
Instruments: lpmd ler L.lim L.lge lolexport ldm lir d81						

نتایج برآوردی معادله کسری بودجه گزارش شده در جدول (۸) نشان می‌دهند که کسری تراز تجاری اثر مثبت و معنی‌داری را بر کسری بودجه نشان می‌دهد که با انتظارات نظری و تجربی موافقت دارد. متغیر نرخ بهره اثر منفی و معنی‌داری بر روی کسری بودجه نشان می‌دهد که بیانگر متأثر شدن عملیات اقتصادی دولت از نرخ بهره است. بنابراین هر گونه افزایش در نرخ بهره که شرایط انقباضی را ایجاد می‌کند، منجر به تعدیل کسری بودجه دولت می‌شود. حجم پول دارای رابطه منفی با کسری بودجه است ولی از لحاظ آماری معنی‌دار نیست. در نهایت متغیر مجازی $dwar$ به عنوان متغیری که نشان دهنده سالهایی که کشور درگیر جنگ بوده است نقش خود را منعکس کرده است و اثر منفی و معنی‌داری را با کسری بودجه ایجاد کرده است، بدین معنی که اثر واقعی جنگ مبتنی بر تعدیل کسری بودجه در آن دوران بوده است.



جدول (۸) : نتایج برآوردی معادله کسری بودجه دولت

Source	SS	df	MS	Number of obs =	31
Model	1.5547e+10	4	3.8866e+09	F(4, 26) =	20.86
Residual	4.3442e+09	26	167084916	Prob > F =	0.0000
				R-squared =	0.7816
				Adj R-squared =	0.7480
				Root MSE =	12926
Total	1.9891e+10	30	663026696		

db	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]
tb2	1.350968	.2293044	5.89	0.000	.8796261 1.82231
ir	-3304.274	1427.464	-2.31	0.029	-6238.468 -370.0797
m	-.0112881	.059602	-0.19	0.851	-.1338018 .1112255
dwar	-50571.96	9281.667	-5.45	0.000	-69650.7 -31493.22
_cons	105761	29038.86	3.64	0.001	46070.77 165451.2

Instrumented: tb2
Instruments: ir m dwar L.lge L.lim d72 d81

۶- نتیجه گیری

در این مطالعه نشان داده شد که هرگونه تغییر در یک بخش استراتژیک مثل نفت آثار مستقیم و غیر مستقیمی را بر شاخص‌های کلان اقتصادی کشور در طی یک دوره زمانی (۱۳۸۴-۱۳۳۹) ایجاد می‌کند. بدین لحاظ، با اهمیت ترین اثرات مربوط به افزایش در صادرات نفتی و غیر نفتی است که به ترتیب سطح اشتغال را در کشور کاهش و افزایش داده‌است. در این شرایط، با افزایش درآمدهای نفتی ناشی از صادرات نفتی اشتغال در سطح کشور کاهش یافته‌است، که درعمل ناشی از ناکارآمدی این نوع یافته‌ها در بخشهای واقعی اقتصاد در بهینه‌سازی سرمایه‌گذاری‌های واقعی بوده‌است. علاوه بر این نتایج نشان می‌دهند که وجود درآمدهای ارزی نفتی مخارج دولت را نیز در دوره زمانی مورد مطالعه افزایش داده‌است، که می‌توان اثر منفی کسری بودجه دولت را بر سطح اشتغال استنباط نمود. در مقابل، نتایج تجربی این واقعیت را نیز آشکار می‌سازند که هر گونه افزایش در صادرات غیر نفتی که طبعا تقویت بخش خصوصی را بدنبال دارد، منجر به افزایش سطح اشتغال و ایجاد فرصت‌های شغلی در اقتصاد ایران شده‌است این واقعیت نیز وجود داشته است که چنانچه اقتصاد ایران گرایش به بازارهای آزادتری مثل بازار ارز شناور در بازار آزادتر پول داشته باشد، ساختارهای مناسب‌تر و کارآمدی در بخش‌هایی مثل تجارت و پول ایجاد می‌شود، که طبعا منجر به ناکارآمدی بخش دولتی اقتصاد در ایجاد کسری بودجه و نقدینگی می‌شود. بنابراین، توصیه مؤکد یافته‌های این مطالعه بر ایجاد استراتژی‌های مبتنی بر تقویت بخش خصوصی و گرایش به بازار برای رهایی از ناکارآمدی‌های بخش نفتی و بلکه هماهنگ‌سازی آن با بخش‌های اقتصادی کشور است.

فهرست منابع :



- ۱- جعفری هرندی، زهرا. (۱۳۷۹). صادرات غیر نفتی و اشتغال. پایان نامه کارشناسی ارشد. دانشکدهی اقتصاد دانشگاه تهران.
- ۲- هوازاده. محمود. (۱۳۸۶). تأثیر کسری تراز تجاری بر کسری بودجه در ایران. پایان نامه کارشناسی ارشد رشته مدیریت علوم بانکی. موسسه عالی بانکداری ایران.
- ۳- متوسلی، محمود و معصومه فولادی (۱۳۸۵). بررسی آثار افزایش قیمت جهانی نفت بر تولید ناخالص داخلی و اشتغال در ایران با استفاده از یک مدل تعادل عمومی محاسبه‌ای. مجله تحقیقات اقتصادی. شماره ۷۶، ص ۶۷-۵۱.
- ۴- جعفری صمیمی، احمد و محمد علیزاده و خسرو عزیزی (۱۳۸۵). بررسی رابطه بلند مدت کسری بودجه و عملکرد اقتصاد کلان در ایران: یک تحلیل نظری و تجربی. فصلنامه پژوهشهای اقتصادی. سال ششم. شماره چهارم. زمستان ۸۵.
- ۵- زمانی راد، عباس. (۱۳۷۷). برآورد رابطه تعادلی بلند مدت بین کسری بودجه و کسری تراز تجاری با استفاده از تکنیک همگرایی. پایان نامه کارشناسی ارشد. دانشکدهی اقتصاد دانشگاه شهید بهشتی.
- ۶- معروف خانی، علی. (۱۳۷۷). بررسی ارتباط کسری بودجه دولت و تورم در اقتصاد ایران. پایان نامه کارشناسی ارشد. دانشکدهی اقتصاد دانشگاه شهید بهشتی.
- ۷- شفیعی، افسانه و شهرزاد برومند و احمد تشکینی (۱۳۸۳). آزمون تأثیرگذاری سیاست مالی بر رشد اقتصادی. پژوهشنامه اقتصادی. ص ۱۱۲-۸۲.
- ۸- ذالنور، سید حسین. مقدمه‌ای بر روشهای اقتصاد سنجی. انتشارات دانشگاه شیراز، ۱۳۷۴.

9- Balssa, Bela. "Exports and Economic Growth Further Evidence". Journal of Development Economic, 1978, VOL.5, NO.2, p.181-189.

10- Chenery, H.B and Bruno, M."Development Alternatives in an Open Economy", Economic Journal, LXXII (March 1962), p. 79-103

11- Khan, Ashfaque-H and Khanum, Shabiha, "Exports and Employment :a case Study", Economic, Internationalize, 1997, 50(2), May 1997, p. 82-261.

12- Tayebi, S.K. (1998), Econometric Modeling of Import Demand in Developing Countries : The Case of Iran, PhD Dissertaion, University of Wollongong, Australia



همایش ملی افزایش درآمدهای نفتی و ایجاد فرصت های شغلی
بیست و پنجم مهرماه ۱۳۸۷ - دانشگاه آزاد اسلامی واحد خمینی شهر