

سلام افلا



وزارت علوم، تحقیقات و فناوری
پژوهشگاه علوم انسانی و مطالعات فرهنگی
پژوهشکده اقتصاد

پایان نامه کارشناسی ارشد رشته علوم اقتصادی گرایش اقتصاد نظری

بررسی تجربی نظریه چرخه‌های تجاری حقیقی در اقتصاد ایران
با تاکید بر شوک مخارج دولتی

استاد راهنما :

دکتر کامران ندری

استاد مشاور :

دکتر سید حسین میرجلیلی

پژوهشگر :

علیرضا تقدیری

شهریور ۹۱



وزارت علوم، تحقیقات و فناوری
پژوهشگاه علوم انسانی و مطالعات فرهنگی
مدیریت تحصیلات تکمیلی

باسمه تعالی

هیأت داوران در جلسه مورخ ۱۳۹۱/۱۰/۰۲

پایان نامه تحصیلی آقای علیرضا تقدیری دانشجوی مقطع کارشناسی ارشد رشته علوم اقتصادی

تحت عنوان:

بررسی تجربی نظریه چرخه های تجاری حقیقی در اقتصاد ایران با تاکید بر شوک مخارج دولتی

را بررسی کردند و پایان نامه با درجه بسیار خوب به تصویب نهایی رسید.

۱. استاد راهنمای پایان نامه، آقای دکتر کامران ندری با مرتبه علمی استادیار

۲. استاد مشاور پایان نامه، آقای دکتر سیدحسین میرجلیلی با مرتبه علمی دانشیار

۳. استاد داور مدعو، آقای دکتر تیمور محمدی با مرتبه علمی استادیار

امضا

امضا

امضا

امضای رئیس پژوهشگاه

امضای مدیر گروه

امضای نماینده مدیریت تحصیلات تکمیلی

سپاسگزاری

بدین وسیله از مساعدت و راهنمایی های جناب آقای دکتر کامران ندری در مقام استاد راهنما که نقش بسزایی در انجام پایان نامه داشته اند و با دقت و صرف وقت زیاد اینجانب را در جهت رسیدن به اهداف تحقیق یاری نموده اند، صمیمانه تشکر و قدردانی می نمایم. همچنین از استاد محترم جناب آقای دکتر سیدحسین میرجلیلی که در مقام استاد مشاور اینجانب بوده اند نیز کمال تشکر را دارم . در ضمن از استاد محترم داور جناب آقای دکتر تیمور محمدی نیز به جهت بذل توجه و مساعدت ایشان سپاسگزارم.

تقدیم به:

مهندس علیرضا تقدیری

چکیده:

این پژوهش با استفاده از یک مدل تحلیلی تعادل عمومی پویای تصادفی، به بررسی تاثیر شوکهای ناشی از مخارج دولت بر روی مسیر تولید، و دیگر متغیرهای کلان در اقتصاد ایران میپردازد. نتایج این پژوهش نشان می‌دهد که در پاسخ به چنین شوکهایی، اشتغال، نرخ بهره، و عرضه نیروی کار افزایش، و متغیرهایی مانند مصرف، سرمایه گذاری، و دستمزد حقیقی کاهش می‌یابند.

همچنین نتایج این پژوهش نشان می‌دهد که شوکهای مخارج دولتی، خصوصا در مقایسه با شوکهای بهره‌وری، اگرچه دارای اثر مثبت بر روی مسیر تولید هستند، ولی این اثر چندان قابل توجه نبوده و طی چند دوره به سرعت مستهلک می‌شوند.

فهرست مطالب:

فصل اول - کاریات تحقیق

.....۲۱-۱ تعریف مساله
.....۲۲-۱ اهمیت و ضرورت انجام این پژوهش (چرایی پژوهش درباره این موضوع):
.....۳۳-۱ قلمرو پژوهش
.....۳۴-۱ سوال‌های پژوهش
.....۴۵-۱ فرضیه‌های پژوهش
.....۴۶-۱ پیشینه پژوهش
.....۴۷-۱ جنبه‌ی جدید بودن و نوآوری پژوهش
.....۸۸-۱ روش انجام پژوهش و دلایل انتخاب این روش
.....۸۹-۱ فنون و ابزارهای گردآوری اطلاعات
.....۹۱۰-۱ فنون و روش تجزیه و تحلیل اطلاعات
.....۹۱۱-۱ کاربرد پژوهش

فصل دوم - ادبیت موضوع

.....۱۲۱-۲ مقدمه
.....۱۲۲-۲ نوسانات تجاری و اهمیت آنها
.....۱۴۳-۲ شاخص‌های ادوار تجاری
.....۱۶۴-۲ نظری چرخه‌های تجاری حقیقی
.....۲۰۵-۲ شوک‌ها و علل ایجاد چرخه‌های تجاری
.....۲۳۶-۲ جایگزینی‌هایی برای شوک تکنولوژی
.....۲۷۷-۲ مدل‌های تعادل عمومی پویای تصادفی DSGE
.....۲۹۸-۲ پژوهش‌های ادوار تجاری در ایران

فصل سوم - مخارج دولت

.....۳۴

..... ۳۴	۱-۳ نحوه دخالت دولت در اقتصاد ایران
..... ۳۶	۲-۳ مخارج دولت
..... ۴۲	۳-۳ وابستگی به درآمدهای نفتی
..... ۴۳	۴-۳ رفتار مخارج دولت در ایران

.....۵: فصل چهارم- ارائه یک مدل تعادل عمومی پویای تصادفی برای اقتصاد ایران

..... ۵۰	۱-۴ نقد لوکاس و مدل‌های پای خرد
..... ۵۰	۲-۴ مدل رشد solow
..... ۵۳	۳-۴ مدل نسل‌های متداخل Diamond
..... ۵۴	۴-۴ مدل Ramsey-Cass-Koopmans
..... ۵۴	۱-۴-۴ فروض مدل در مورد بنگاه‌ها
..... ۵۵	۲-۴-۴ فروض مدل در مورد خانوارها
..... ۵۶	۳-۴-۴ فروض مدل در مورد رفتار بنگاهها
..... ۵۶	۴-۴-۴ مساله حداکثر سازی خانوار
..... ۵۸	۵-۴-۴ رفتار خانوار
..... ۵۸	۵-۴ مدل‌های مورد استفاده برای تحلیلی نوسانات
..... ۵۸	۱-۵-۴ مدل‌های والراسی و RBC
..... ۶۰	۲-۵-۴ مدل‌های سنتی کثیری
..... ۶۰	۶-۴ بررسی یک مدل RBC پای براساس مدل Ramsey
..... ۶۲	۱-۶-۴ رفتار متغی‌های تکنولوژی و خریدهای دولت
..... ۶۳	۲-۶-۴ جایگزینی تن دوره ای در عرضه نیروی کار
..... ۶۵	۳-۶-۴ بهینه سازی در شرایط ناطم‌نای
..... ۶۸	۴-۶-۴ حل مدل در حالت عمومی

.....۷: فصل پنجم- تخمین پارامترها و حل مدل در حالت عمومی برای اقتصاد ایران

..... ۷۱	۱-۵ تخمین پارامترهای مدل برای اقتصاد ایران
..... ۷۱	۱-۱-۵ برآورد پارامترهای تکنولوژی
..... ۷۶	۲-۱-۵ برآورد پارامتر نرخ استهلاك
..... ۷۷	۳-۱-۵ برآورد پارامتر نرخ رشد جمعیت

.....۷۸.....	۴-۱-۵ برآورد پارامتر عرضه سرانه نیروی کار در حالت پایدار
.....۸۰.....	۵-۱-۵ برآورد نسبت مخارج دولت به تولد در حالت پایدار * GY
.....۸۲.....	۶-۱-۵ برآورد نرخ بهره حقیقی در حالت پایدار
.....۸۳.....	۲-۵ حل مدل در حالت عمومی
.....۸۴.....	۱-۲-۵ خطی لگاریتمی سازی مدل
.....۸۵.....	۲-۲-۵ روش‌های خطی-لگاریتمی سازی مدل حول مسری رشد متعادل
.....۸۷.....	۳-۲-۵ خطی-لگاریتمی سازی به کمک تخمین سری نظور
.....۹۱.....	۴-۲-۵ یافتن معادله مسری حرکت موجودی سرمایه $Kt + 1$

فصل ششم - ارائه و تحلیل نتایج مدل

فهرست نمودارها:

.....۲۲.....	نمودار ۱-۲ نرخ رشد تولد و نرخ رشد تکنولوژی (مانده سولو) (Mankiw, ۲۰۱۰).
.....۳۷.....	نمودار ۳-۱ هزینه‌های مصرفی دولتی (مطلوبه ردی) به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶.
.....۳۸.....	نمودار ۳-۲ سرمایه‌گذاری دولتی در بخش‌های ماشین‌آلات و ساختمان (مطلوبه ردی) به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶.
.....۳۹.....	نمودار ۳-۳ نمودار مقایسه‌ای بین هزینه‌های مصرفی و هزینه‌های عمرانی (سرمایه‌گذاری دولتی) به قیمت ثابت سال ۱۳۷۶.
.....۴۴.....	نمودار ۴-۳ نمودار لگاریتمی مخارج دولت (۱۳۶۷-۱۳۸۷).
.....۴۵.....	نمودار ۵-۳ رفتار G در طول زمان.
.....۴۷.....	نمودار ۶-۳ رفتار $t, \varepsilon G$ (پسماند G) در طول زمان.
.....۴۸.....	نمودار ۷-۳ سرعت جذب شوک یک درصدی برای ضرایب مختلف ρG .
.....۷۴.....	نمودار ۱-۵ رفتار لگاریتمی تکنولوژی در طول زمان.
.....۷۵.....	نمودار ۲-۵ لگاریتمی درآمد سرانه در طول زمان.
.....۷۸.....	نمودار ۳-۵ لگاریتمی طبیعی جمعیت کشور.
.....۷۹.....	نمودار ۴-۵ نسبت شاغلین به کل جمعیت در ایران و جهان.
.....۸۱.....	نمودار ۵-۵ نسبت مخارج دولت به تولد ناخالص داخلی.
.....۸۳.....	نمودار ۶-۵ برآورد فصلی نرخ بهره تعادلی (۱۳۸۶-۱۳۶۸).

.....۱:۵.....	نمودار ۱-۶ اثر شوک ۱۰ درصدی مخارج دولت بر مسری تولی.
.....۱:۷.....	نمودار ۲-۶ اثر شوک ۱۰ درصدی تکنولوژی بر مسری تولی.
.....۱:۸.....	نمودار ۳-۶ اثر شوک‌های ۱۰ درصدی تکنولوژی و مخارج بر مسری تولی.
.....۱:۹.....	نمودار ۴-۶ اثر شوک ۱۰ درصدی مخارج دولت بر مسری تولی و مصرف.
.....۱:۹.....	نمودار ۵-۶ اثر شوک ۱۰ درصدی مخارج دولت بر مسری عرضه نئوی کار و موجودی سرمای.
.....۱:۱:.....	نمودار ۶-۶ اثر شوک ۱۰ درصدی مخارج دولت بر مسری دستمزد و نرخ بهره حقیقی.

فهرست جداول:

.....۴:۳.....	جدول شماره ۳-۱ داده‌های مربوط به لگاریتم مخارج دولت و میزان انحراف از وضعیت پائار (۱۳۶۷-۱۳۸۶)
.....۷:۳.....	جدول شماره ۵-۱ محاسبه بهره‌وری کل (تکنولوژی) با استفاده از روش پسماند سولو
.....۷:۷.....	جدول ۵-۲ نرخ رشد سالانه جمعیت در بازه‌های زمانی ۱۰ ساله
.....۸:.....	جدول ۵-۳ آمار مربوط به اشتغال و نئوی کار
.....۱:۱:.....	جدول ۵-۴ نتیجه حل مدل در نرم افزار EXCEL

فهرست تصاویر:

.....۴:۱.....	شکل ۱-۳ رابطه مکان دولت و رشد اقتصادی.
---------------	--

فصل اول

کلیات تحقیق

فصل اول - کلیات تحقیق

۱-۱ تعریف مساله

علت بروز نوسانات اقتصادی یا همان دوره‌های رکود و رونق همواره یکی از مهمترین مسائل مورد توجه اقتصاددانان و سیاستگذاران بوده است. نظریه ادوار تجاری حقیقی (Real Business Cycles) مکتب کلاسیک‌های جدید، از جمله نظریاتی است که می‌تواند نوسانات اقتصادی کوتاه مدت را به گویاترین شکل توضیح دهد. اگرچه الگوی کلاسیک به دلیل در نظر نگرفتن چسبندگی قیمت‌ها نمی‌تواند نوسانات کوتاه مدت را توجیه کند، ولی در نظریه ادوار تجاری حقیقی با رعایت مفروضات الگوی کلاسیک (و در نظر گرفتن فرض عرضه بین دوره‌ای نیروی کار (Intertemporal Substitution of Labor)، می‌توان نوسانات اقتصادی در کوتاه مدت را توجیه کرد. کلاسیک‌های جدید نقش چسبندگی دستمزدها و قیمت‌ها را در تحلیل نوسانات اقتصادی چندان موثر ندانسته و این فرض را به دلیل ایجاد رابطه قویتر بین تئوری‌های اقتصاد خرد و کلان، از لحاظ روش‌شناسی، بر فرض چسبندگی قیمت‌ها ارجح می‌دانند. لذا سیاست‌های پولی و یا تغییر سطح قیمت‌ها تاثیری در سطح اشتغال و تولید ندارد.

در واقع در نظریه ادوار تجاری حقیقی تغییر متغیرهای اسمی مانند سطح قیمت‌ها و عرضه پول بر متغیرهای حقیقی مثل سطح اشتغال و تولید اثر نداشته و برای توجیه نوسانات متغیرهای حقیقی تنها باید به تغییرات متغیرهای حقیقی مانند شوک‌های مخارج دولتی و شوک‌های تکنولوژی تولید توجه کرد.

با توجه به سهم بالای دولت در اقتصاد کشور و وابستگی بالای بودجه دولت به قیمت نفت و نوسانات شدید آن، شوک‌های ناشی از مخارج دولتی چه تاثیری در ایجاد دوره‌های رکود و رونق و بر رفتار متغیرهای کلان اقتصاد کشور، به خصوص تولید ناخالص داخلی، در طول زمان خواهد داشت؟

از سوی دیگر در مدل‌های تجربی و سنتی اقتصادسنجی، روابط مشاهده شده بین مقادیر متغیرهای مختلف، که در طول زمان استخراج می‌شود، با تغییر رژیم سیاستی کلان اقتصاد تغییر می‌کنند. در واقع روابط بدست آمده بین متغیرها وابسته به سیاست‌ها و شرایط جاری بوده و با تغییر آن دچار دگرگونی می‌شود. این بدان معناست که امکان پیش‌بینی اثرات یک سیاست جدید با استفاده از یک مدل پیش‌بینی تجربی که بر پایه داده‌ها و سیاست‌های گذشته بنا شده، وجود ندارد.

در حقیقت تا زمانی که اقتصاددان مدل‌های خود را بر مبنای نظریات پایه‌ای اقتصاد (مانند ترجیحات، تکنولوژی و محدودیت‌های بودجه)، که نسبت به تغییرات سیاستی بی‌تفاوت هستند بنا نکنند، نمی‌توانند اثرات سیاست‌های جدید را به درستی پیش‌بینی کنند.

در این تحقیق سعی می‌کنیم ضمن بررسی ویژگی‌های ادوار تجاری در اقتصاد ایران بفهمیم چقدر شوک‌های ناشی از تغییرات ناگهانی در برنامه‌های مالی دولت در بوجود آمدن دوره‌های رونق و رکود مؤثر بوده است؟

۱-۲ اهمیت و ضرورت انجام این پژوهش (چرایی پژوهش درباره این موضوع):

اقتصاددانان، سیاستگذاران و عموم مردم همواره به دنبال یافتن علل، زمان، ابعاد و شدت نوسانات اقتصادی در بخش‌های مختلف هستند. امروزه بررسی نحوه پیدایش و چگونگی انتشار شوک‌های مؤثر بر ادوار تجاری، یکی از اصلی‌ترین مباحث اقتصاد کلان است. با شناخت صحیح از نوسانات اقتصادی می‌توان سیاست‌های اقتصادی مناسب را در جهت تعدیل یا خنثی کردن نوسانات نامطلوب اقتصادی اتخاذ نمود. در حقیقت شناخت و درک ادوار تجاری، اولین گام در طراحی مناسب سیاست‌های تثبیت است.

با توجه به نقش شوک‌های مخارج دولتی، به عنوان یک عامل تاثیر گذار در ایجاد ادوار تجاری، و سهم بالای دولت در اقتصاد کشور، و همچنین نوسانات قابل توجه مخارج دولت (ناشی از تغییرات قیمت نفت، سیاست‌های اقتصادی و ...)، بررسی میزان و نحوه تاثیر شوک‌های مخارج دولتی بر تولید کشور، و دوره‌های رکود و رونق، جهت سیاست‌گذاری‌های اقتصادی ضروری به نظر می‌رسد.

۱-۳ قلمرو پژوهش

قلمرو موضوعی این پژوهش در مورد اقتصاد کلان و ادوار تجاری است. در این پژوهش به بررسی تجربی نظریه ادوار تجاری حقیقی به عنوان یکی از نظریات مهم ادوار تجاری در اقتصاد ایران خواهیم پرداخت. تمرکز ما در این تحقیق تغییرات در مخارج دولتی و شوک‌های حاصل از آن به عنوان یک شوک حقیقی خواهیم پرداخت.

دامنه زمانی این پژوهش در فاصله سال‌های ۱۳۶۸-۱۳۸۷ در نظر گرفته شده است. در نظر گرفتن این دامنه زمانی باعث می‌شود تا اثرات ناشی از جنگ تحمیلی بر شرایط کشور و مخارج دولت و در نتیجه بر نتایج تحقیق کاسته گردد.

۴-۱ سوال‌های پژوهش

سوال اصلی این پژوهش این است که شوک‌های ناشی از مخارج دولتی چه تاثیری بر دوره‌های رکود و رونق دارد؟^۱ به بیان دقیقتر نوسان مخارج دولت حول مسیر رشد خود، چه تاثیری بر رفتار متغیرهای کلان اقتصادی به خصوص تولید ناخالص داخلی در طول زمان خواهد داشت؟

۵-۱ فرضیه‌های پژوهش

فرض اصلی در این پژوهش این است که شوک‌های ناشی از تغییرات مخارج دولتی، به عنوان یک شوک حقیقی، عامل مهمی در بروز ادوار تجاری در ایران هستند.

۶-۱ پیشینه پژوهش

در دهه ۱۹۶۰ بسیاری از اقتصاددانان ادوار تجاری را پدیده‌ای مربوط به گذشته می‌دانستند و گمان می‌کردند الگوی کینزی تمام ابزارهای لازم برای استفاده از اهرم‌های سیاست‌های پولی و مالی، جهت کنترل تقاضای کل را پدید آورده است.

در نگاه آنان استفاده بیش از حد از محرک‌های تقاضا سبب بروز تورم، و کمبود تقاضا باعث بروز بیکاری می‌گشت. تنها مسئله‌ای که باقی می‌ماند، تعیین وضعیت بهینه روی منحنی فیلیپس بود. یعنی معاوضه بین بیکاری و تورم. نبود پایه‌های خرد برای توصیف روابط رفتاری متغیرهای کلان، تنها چالشی روشنفکری به شمار می‌آمد که نباید مانع تلاش‌های سیاستگذاران برای تثبیت اقتصاد می‌شد. اما بازگشت ادوار تجاری در دهه ۱۹۷۰، همراه با نرخ‌های بالای تورم، آن هم بعد از یک دهه رونق اقتصادی، کفایت نظریه‌های کینزی گذشته را زیر سوال برد. دیگر موفقیت تجربی نظریه‌های کینزی و پایه‌های نظری مناسب آن را نمی‌شد کافی دانست. در واقع کمبود اصلی در تفسیر کینزی، نبود پایه‌های روشن سازگار با مبانی اقتصاد خرد بود.

آخرین موج حمله به نظریه‌های اقتصاد کلان کینزی، نظریه ادوار تجاری واقعی بود که در دهه ۱۹۸۰ بوسیله فین کیدلند، ادوارد پرسکات، و چارلز پلوسر ارائه شد. بر مبنای این نظریه، ادوار تجاری، چه در ماهیت خود و چه در اثر مداخله دولت، به هیچ عنوان نشان دهنده شکست مکانیزم بازار نیست. بلکه واکنشی است موثر در قبال تغییرات برون‌زا در فرصت‌های تولید. از ویژگی‌های دیگر این نظریه توجه نکردن به عوامل پولی و یا هر

نوع متغیر اسمی دیگر است. اقبال به این نظریه نه تنها به خاطر نو بودنشان، که به خاطر مسائلی چون انتقادهای لوکاس، فرضیه شوک‌های تکنولوژی و دیگر مسائل تئوریک باقیمانده مانند حرکت مزد واقعی در جهت مخالف سیکل‌ها، و حرکت قابل توجه معیارهای بهره‌وری در جهت ادوار بود. در نهایت دو شوک بزرگ نفتی اوپک در دهه ۱۹۷۰ پذیرش این فرضیه را که شوک‌ها و اختلالات حقیقی از عوامل مهم در بروز نوسان‌های اقتصادی هستند را آسانتر کرد.

در نظریه ادوار تجاری باور بر این است که سیکل‌ها عمدتاً به دلیل شوک‌های واقعی از قبیل تغییر در بهره‌وری، تغییرات تکنولوژی، تغییرات شدید در عرضه مواد خام، سیاست‌های مالی و... بوجود آمده‌اند. مدل‌های ادوار تجاری واقعی بر اساس مدل Ramsey-Cass-Koopmans توسعه یافته‌اند. در این الگو متغیرهای کلان اقتصادی حاصل تصمیم‌گیری عاملان اقتصادی است که در جهت حداکثر کردن مطلوبیت خود که تابعی از مصرف و فراغت می‌باشد، با توجه به محدودیت منابع و امکانات تولید عمل می‌کنند. این مدل‌ها در قالب مدل تعادل عمومی والراسی ارائه می‌شوند و لذا تنها عواملی می‌توانند باعث ایجاد نوسانات اقتصادی شوند که تعادل والراسی را تغییر دهند. در مدل‌های ادوار تجاری حقیقی با وارد کردن متغیر استراحت در تابع مطلوبیت و بهره‌گیری از نظریه جانشینی بین دوره‌ای نیروی کار، عکس‌العمل نیروی کار در پاسخ به تغییرات نرخ بهره حقیقی و دستمزدهای حقیقی توضیح داده می‌شود. نیروی کار با در نظر گرفتن نرخ بهره حقیقی و دستمزد حقیقی حال و مورد انتظار آینده و محاسبه ارزش حال مطلوبیت تصمیم می‌گیرد که چگونه در با توجه شوک‌های حقیقی ساعت کار و استراحت خود را انتخاب کند. لذا این الگوها دارای پایه‌های محکم اقتصاد خرد هستند.

نوشته‌ها در مورد ادوار تجاری حقیقی، روش‌شناسی جدیدی را هم برای تحلیل‌های نظری، و هم برای تحلیل‌های تجربی پیشنهاد کردند. این تحقیقات به ما نشان دادند که چگونه می‌توان با روش تعادل عمومی بین دوره‌ای ارائه شده توسط لوکاس، یک الگوی کامل ادوار تجاری ساخته و با اختصاص ارزش‌های عددی به پارامترها و محاسبات عددی مربوط به معادلات مدل، به جای نتیجه‌گیری‌های کیفی حاصل از دیگر نظریات عمومی‌تر، به نتایج کمی رسید.

پژوهش‌های زیادی در باب علل، زمان، ابعاد و شدت ادوار تجاری و نوسانات در اقتصاد ایران انجام گرفته است. عمده پژوهش‌ها بر یافتن همبستگی یا هم‌حرکتی بین سری‌های زمانی متغیرهای کلان اقتصادی، و

شکاف تولید ناخالص داخلی (تفاضل تولید ناخالص داخلی و تولید بالقوه) و یا دیگر شاخص‌های مرتبط با ادوار تجاری، متمرکز بوده است.

از جمله پژوهش‌های انجام شده در باب علت بروز ادوار تجاری در ایران می‌توان به پژوهش‌های زیر اشاره کرد، درگاهی و دیگران (۱۳۸۵) در مقاله خود در قالب یک مدل ادوار تجاری چند بخشی، نقش و اهمیت شوک‌های کلان و بخشی در ادوار تجاری زیر بخش‌های صنعت ایران را بررسی کردند. تغییرات غیر قابل انتظار متغیرهای مهم اقتصاد کلان چون حجم پول، مخارج دولت، نرخ ارز و درآمد ارزی حاصل از صادرات نفت به عنوان شوک‌های کلان، و تحولات بهره وری در زیر بخش‌های مختلف به عنوان شوک‌های بخشی، در نظر گرفته شده است. نتایج نشان داد که در اقتصاد ایران شوک‌های کلان نقش قابل توجهی در ایجاد ادوار تجاری صنعت داشته و اثر شوک‌های بهره وری اگر چه در توضیح نوسانات رشد صنعت معنادار است، ولی دارای نقش کمتری است.

هوشمند و دیگران (۱۳۸۷) در مطالعه خود تولید ناخالص داخلی واقعی اقتصاد ایران را به سه جزء روند بلندمدت، نوسانات چرخه ای و حرکات نامنظم با استفاده از فیلتر هادریک - پرسکات تفکیک کرده و سپس بر اساس مطالعه لوکاس (Lucas, 1977)، حقایق آشکار شده ادوار تجاری شامل هم حرکتی میان متغیرهای کلان اقتصادی، تغییرپذیری نسبی و پایداری آنها در طول چرخه‌ها را شناسایی کردند. در مورد متغیرهای پولی نیز نتایج این تحقیق نشان می‌دهد که ادوار تجاری اقتصاد ایران پدیده ای غیرپولی است. نتایج آزمون علیت گرنجری نیز حاکی از آن است که نوسانات صادرات نفت و گاز می‌تواند به عنوان منبع اصلی ادوار تجاری در اقتصاد ایران شناخته شود.

شریف آزاده و دیگران (۱۳۸۷) در مقاله خود با عنوان "بررسی عوامل مؤثر بر ادوار تجاری در اقتصاد ایران"، با استفاده از سیستم معادلات همزمان و به کمک روش خودرگرسیون برداری (VAR) عوامل مؤثر بر ادوار تجاری در اقتصاد ایران را بررسی می‌نماید. به منظور شناخت دلیل نوسانات در اقتصاد ایران با توجه به متغیرهای موجود در مدل هم حرکتی این متغیرها با شکاف تولید (تفاضل تولید ناخالص داخلی و تولید بالقوه)، با استفاده از شاخص ضریب همبستگی متقابل بررسی شده است. نتایج نشان داد که تکانه‌های وارد شده از سمت متغیرهای موجود در مدل (نرخ تورم، نرخ رشد ارز، نرخ رشد نقدینگی و درآمد‌های حاصل از صادرات نفت و گاز) بر شکاف تولید، سبب افزایش شکاف تولید شده که این امر خود تاییدی بر تاثیر مستقیم و مثبت این عوامل در ایجاد و تداوم ادوار تجاری در اقتصاد ایران است.

اما مطالعه در ادبیات مدل‌های ادوار تجاری حقیقی در اقتصاد ایران نوظاست. البته با اطمینان می‌توان بیان کرد که این مدل‌ها تاکنون برای اقتصاد ایران به صورت جدی معرفی و تصریح نشده‌اند. (عباسی نژاد، ۱۳۸۸) مطالعات نشان دهنده مهم بودن شوک‌های طرف عرضه بر روی متغیرهای کلان اقتصاد ایران است که خود مؤید کاربردی بودن مدل‌های ادوار تجاری حقیقی (RBC) برای اقتصاد ایران است. به نظر می‌رسد که برآورد یک مدل ساده، نه تنها توانمندی مدل‌های RBC را برای شبیه‌سازی نوسانات و هم حرکتی متغیرهای کلان اقتصاد ایران مورد آزمون قرار می‌دهد بلکه زمینه‌ای فراهم می‌کند که بتوان در مطالعات بعدی با افزودن و تعدیل آن براساس سایر ویژگی‌های خاص اقتصاد ایران، قدرت توضیح دهنده‌ی آن را برای اقتصاد ایران افزایش داد. (همان)

در مورد علل نوسانات و اهمیت هر کدام اتفاق نظر وجود ندارد. در پژوهش‌هایی که بر اساس مدل ادوار تجاری حقیقی (RBC) صورت گرفته، ادوار تجاری در ایران را عمدتاً پدیده‌ای غیر پولی دانسته و نقش شوک‌های طرف عرضه از قبیل شوک‌های تکنولوژی را معنا دار، بلندمدت و دارای تاثیر تجمعی، و نقش شوک‌های طرف تقاضا بر تولید را گذرا دانسته‌اند. در حالی که در شماری دیگر از پژوهش‌ها، برای تغییرات غیر منتظره متغیرهای کلانی مانند حجم پول، مخارج دولت، نرخ ارز و درآمد ارزی حاصل از صادرات نفت، به عنوان شوک‌های کلان، نقش قابل توجهی در ادوار تجاری قائل شده و اثر شوک‌های بهره‌وری را معنادار، اما کمتر از دیگر متغیرها ارزیابی کرده‌اند.

محمدی و دیگران (۱۳۸۷) در مقاله‌ای با عنوان "اثر شوک‌های بهره‌وری بر رشد اقتصادی ایران"، به بررسی این شوکها با استفاده از یک مدل ادوار تجاری واقعی با تکنولوژی درون‌زا پرداختند. نتایج این تحقیق نشان می‌دهد که شوک‌های طرف تقاضا به تنهایی اثر معنی‌داری بر رشد اقتصادی نداشته، شوک‌های طرف عرضه اثر معناداری بر رشد اقتصادی دارند. همچنین تاثیر شوک‌های طرف تقاضا بر تغییرات تولید گذرا و شوک‌های طرف عرضه (شوک‌های بهره‌وری) تاثیر تجمعی بر رشد اقتصادی دارند.

عباسی نژاد و دیگران (۱۳۸۸) در مقاله خود با عنوان "برآورد یک مدل ادوار تجاری واقعی برای اقتصاد ایران با استفاده از رهیافت فیلتر کالمن و حداکثر راستنمایی"، با در نظر گرفتن شرایط کشورهای در حال توسعه و وارد کردن نرخ رشد در مدل خود، به برآورد یک مدل RBC براساس رهیافت حداکثر راستنمایی و روش فیلتر

کالمن پرداختند. نتایج حاکی از موثر بودن و پایدار بودن شوک‌های حاصل از تکنولوژی و اثرات بلندمدت آن بر اقتصاد کشور دارد.

در شماری از پژوهش‌های اشاره شده نیز با تفکیک سری زمانی مربوط به تولید ناخالص داخلی به ۳ بخش روند بلندمدت، نوسانات چرخه‌ای و حرکات نامنظم، برخی از نتایج دیدگاه لوکاس، مانند هم‌حرکتی میان متغیرهای کلان و تغییرات بالای سرمایه‌گذاری و مصرف کالاهای با دوام در اقتصاد ایران مورد تایید قرار گرفته است.

در عمده پژوهش‌های صورت گرفته، بر نقش نوسانات درآمدهای نفتی، به عنوان عامل اصلی در پیدایش ادوار تجاری در ایران، تاکید شده است. در واقع از میان متغیرهای موثر بر تولید، درآمدهای نفتی بیشترین درصد توضیح دهنده را به خود اختصاص داده‌اند. برای تحلیل اقتصاد ایران با رویکرد نظریه ادوار تجاری حقیقی، از شوک‌های قیمت نفت به عنوان جانشینی برای شوک تکنولوژی در تابع تولید استفاده شده است.

۱-۷ جنبه‌ی جدید بودن و نوآوری پژوهش

در این پژوهش به جای بهره‌گیری صرف از مدل‌های سنتی اقتصادسنجی، که وابسته به شرایط سیاستی اقتصاد هستند، از مدل‌هایی استفاده کنیم که بر پایه بهینه‌سازی رفتار عاملین اقتصادی و بر مبنای اصول بنیادین اقتصاد خرد بنا شده بوده و نسبت به شرایط و رژیم سیاستی مستقل هستند.

همچنین تعادل همزمان بازارها را نیز مد نظر قرار داده و به جای بررسی ایستا(استاتیک) متغیرهای کلان، رفتار آنها در طول زمان را مورد توجه قرار داده و اثر شوک‌ها را به عنوان عواملی تصادفی که باعث ایجاد اختلال در اقتصاد شده و گسترش می‌یابند مورد بررسی قرار می‌دهیم.

برای رسیدن به این منظور از یک مدل ساده شده دینامیک و تصادفی (بر مبنای نظریه تعادل عمومی)، یعنی یک مدل ساده شده (DSGE (Dynamic Stochastic General Equilibrium) استفاده خواهیم کرد.

۱-۸ روش انجام پژوهش و دلیل انتخاب این روش

برای انجام این پژوهش از یک مدل ساده شده DSGE (یا مدل پویای تصادفی تعادل عمومی) استفاده خواهیم کرد که بر مبنای بهینه‌سازی رفتار فعالان اقتصادی بوده و برای بررسی ادوار تجاری مناسب است. برای تخمین برخی پارامترهای معادلات موجود در مدل، از روش‌های اقتصادسنجی کمک می‌گیریم.

از آنجایی که مدل DSGE به جای تکیه صرف بر همبستگی مشاهده شده بین متغیرها، بر مبنای اصول پایه‌ای اقتصاد خرد در تصمیم‌گیری با محدودیت، و تعامل بین تصمیم‌گیران اقتصاد، یعنی فعالان اقتصادی بنا شده است، مستقل از سیاست‌های جاری اقتصادی بوده و نتایج حاصل آن از دقت و صحت بیشتری برخوردار است. با استفاده از ۲ ویژگی دینامیک بودن و تصادفی بودن این روش، می‌توانیم روند دگرگونی اقتصاد در طول زمان، و نیز اثر شوک‌های تصادفی مانند تغییرات تکنولوژیکی، نوسانات قیمت نفت و یا خطاهای ناشی از سیاستگذاری را مد نظر قرار داده و مطالعه کرد.

۹-۱ فنون و ابزارهای گردآوری اطلاعات

برای جمع‌آوری اطلاعات و داده‌های این پژوهش و نگارش ادبیات موضوع، از مطالعات کتابخانه‌ای بهره گرفته می‌شود. برای به دست آوردن داده‌ها و اطلاعات مورد نیاز، از منابع کتابخانه‌ای، شامل کتب فارسی و لاتین، و نیز منابع و مقالات موجود در پایگاه‌های معتبر اینترنتی از جمله پایگاه‌های مرکز آمار ایران و بانک مرکزی، و همچنین بانک‌های اطلاعات مجلات معتبر علمی و پژوهشی و ... استفاده می‌شود.

۱۰-۱ فنون و روش تجزیه و تحلیل اطلاعات

ابتدا ترجیحات یا همان اهداف عاملین اقتصادی را تعریف می‌کنیم. برای مثال خانوارها با انتخاب ترکیب بین مصرف و عرضه نیروی کار، و بنگاه‌ها با انتخاب ترکیب کار و سرمایه سود خود به دنبال حداکثر کردن مطلوبیت و سود خود هستند. با تعیین توابع مطلوبیت و تولید برای بنگاه و خانوار نمونه و بهینه‌سازی آنها، رابطه بین دو متغیر درونزای مصرف و عرضه نیروی کار در هر دوره را بدست می‌آوریم. با در نظر گرفتن رابطه خطی بین لگاریتم متغیرهای مصرف و اشتغال (عرضه نیروی کار)، و لگاریتم متغیرهای ذخیره سرمایه، ارزش جاری تکنولوژی و هزینه‌های دولت، به عنوان متغیرهایی که وضعیت اقتصاد را در هر دوره نشان می‌دهد، و تخمین ضرایب این معادله‌ها، می‌توانیم رفتار متغیرهای مصرف و اشتغال را حول مسیر متوازن رشد آنها بررسی کنیم. با استفاده از معادلات باقیمانده مدل، می‌توانیم نحوه پاسخ دیگر متغیرها به خصوص تولید ناخالص داخلی را نیز نسبت به شوک‌های ناشی از مخارج دولت را اندازه‌گیری کرده و توضیح دهیم.

۱۱-۱ کاربرد پژوهش

این طرح می‌تواند مورد استفاده سیاست‌گذاران اقتصادی کشور از قبیل وزارت امور اقتصادی و دارایی، بانک مرکزی و .. باشد. با توجه به نقش شوک‌های مخارج دولتی، به عنوان یک عامل تاثیرگذار در ایجاد ادوار تجاری، و سهم بالای دولت در اقتصاد کشور، و همچنین نوسانات قابل توجه مخارج دولت (ناشی از تغییرات قیمت نفت، سیاست‌های اقتصادی و ...)، بررسی میزان و نحوه تاثیر شوک‌های مخارج دولتی بر تولید کشور، و دوره‌های رکود و رونق، جهت سیاست‌گذاری‌های اقتصادی ضروری به نظر می‌رسد.

فصل دوم

ادبیات موضوع

فصل دوم- ادبیات موضوع

۱-۲ مقدمه

اقتصاددانان، سیاستگذاران و عموم مردم همواره به دنبال یافتن علل، زمان، ابعاد و شدت نوسانات اقتصادی در بخش‌های مختلف هستند. امروزه بررسی نحوه پیدایش و چگونگی انتشار شوک‌های موثر بر ادوار تجاری، یکی از اصلی‌ترین مباحث اقتصاد کلان است. با شناخت صحیح از نوسانات اقتصادی می‌توان سیاست‌های اقتصادی مناسب را در جهت تعدیل یا خنثی کردن نوسانات نامطلوب اقتصادی اتخاذ نمود. مهمترین حقیقت در مورد نوسانات این است که آنها از هیچ‌الگوی ساده یا دوره‌ای پیروی نمی‌کنند. در واقع شناخت و درک ادوار تجاری، اولین گام در طراحی مناسب سیاست‌های تثبیت است. علت بروز نوسانات اقتصادی یا همان دوره‌های رکود و رونق همواره یکی از مهمترین مسائل مورد توجه اقتصاددانان و سیاستگذاران بوده است.

۲-۲ نوسانات تجاری و اهمیت آنها

نوسانات تجاری، عبارتند از تغییرات تکرارشونده در سطح فعالیت‌های اقتصادی. رونق، اوج، رکود و حوضیض ترتیب رویدادهای یک دوره تجاری را تشکیل می‌دهند. نوسانات کوتاه مدت در محصول و اشتغال را چرخه‌ها یا ادوار تجاری می‌نامند. اصطلاح چرخه‌ها یا ادوار تجاری به معنی نوسان در یک بخش از اقتصاد نیست، بلکه از آن برای توصیف نوسان‌هایی که در تمامی بخش‌های اقتصاد وجود دارد، استفاده می‌شود. ادوار تجاری با تغییرات ناشی از رشد و نوسان‌های فصلی تفاوت دارد. به طور کلی زمانی که اقتصاد دوره‌هایی پیاپی از کاهش محصول و افزایش بیکاری را تجربه می‌کند، اصطلاحاً گفته می‌شود که اقتصاد در رکود [□] قرار دارد. زمان شروع یک رکود را اوج [□] چرخه تجاری، و زمان پایان رکود را، حوضیض [□] چرخه تجاری می‌نامند. اگرچه اصطلاح چرخه‌های تجاری، چرخه‌ای و سیکلی بودن، و در نتیجه قابل پیش‌بینی بودن نوسانات را به ذهن متبادر می‌سازد، اما در واقع رکودها به همان اندازه که برای ما پدیده‌های عادی و قابل انتظار هستند، بی‌قاعده و غیر قابل پیش‌بینی نیز هستند. گاهی با فاصله کوتاه از هم اتفاق می‌افتند و گاه با فاصله زیاد. در دامنه گسترش و شدت نیز از هم متفاوت‌اند. رکود سال ۱۹۸۲ که بعد از رکود بزرگ دهه ۳۰ یکی از بزرگترین رکودهای ایالات متحده بود، تنها ۲ سال بعد از رکود قبلی اتفاق افتاد. تولید ناخالص داخلی ۲.۵٪ کاهش یافت و نرخ بیکاری به ۱۰.۸٪ رسید. اما تا زمان رکود بعدی در ۸ سال آینده، اقتصاد به طور مستمر رشد نمود.

□ Recession
□ Peak
□ Trough