



دانشگاه زنجان

دانشکده علوم انسانی

گروه اقتصاد

عنوان پایان نامه

بررسی رابطه بین عرضه پول و تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی و غیررسمی در ایران برای بازه زمانی ۱۳۹۲-۱۳۴۵

The Relationship Between Money Supply and GDP in Iran's Formal and Informal Economy for the Period of 1966-2013

واژگان کلیدی فارسی: عرضه پول، تولید ناخالص داخلی، رشد اقتصادی، اقتصاد رسمی، اقتصاد غیررسمی

واژگان کلیدی انگلیسی: Money Supply, GDP, Economic Growth, Formal Economy, Informal Economy

بیان مسأله

در یک تقسیم‌بندی کلی اقتصاد هر کشور را می‌توان به دو بخش رسمی و غیررسمی تقسیم‌بندی کرد. ملاک این تقسیم‌بندی قابلیت ثبت و گزارش فعالیت‌های اقتصادی موردنظر به‌طور رسمی است (نیلی و ملکی، ۱۳۸۵).

در طول چند سال گذشته به دلیل اهمیت رشد اقتصادی در میان اهداف اقتصاد کلان در کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه، مدل‌سازی و روابط بین عرضه پول و تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی نسبت به هر موضوع دیگر در زمینه اقتصاد پولی، یکی از مسائل اصلی موردعلاقه برای اقتصاددانان، پژوهشگران و سیاست‌گذاران شده است اما همه این توجهات معطوف به بخش رسمی اقتصاد است در حالی که شواهد نشان می‌دهد که سهم قابل توجهی از فعالیت‌های اقتصادی ایران در بخش غیررسمی انجام می‌شود. اقتصاد غیررسمی فعالیت‌های اقتصادی را شامل می‌شود که برخلاف اقتصاد رسمی نه مالیات می‌پردازند و نه تحت نظارت دولت انجام می‌گیرند. بنابراین اقتصاد غیررسمی در محاسبات مربوط به تولید ناخالص ملی وارد نمی‌شوند. حضور بخش غیررسمی به این معناست که درجه سیاست‌پذیری فعالیت‌های اقتصادی از برنامه‌ها و سیاست‌های دولت و قدرت اعمال نظارت دولت، پایین است و نتیجه آن نیز عدم تحقق سیاست‌های اقتصادی دولت یا انحراف آن‌ها از نتایج موردنظر است.

بنابراین شناخت این روابط می‌تواند سیاست‌های اقتصادی را به سمت استفاده با احتیاط از سیاست‌های پولی سوق دهد. همچنین پاسخ به این مسئله که عرضه پول چه رابطه‌ای با تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی و اقتصاد غیررسمی دارد و یا اینکه متغیرهای کلانی در برابر تغییرات عرضه پول چه عکس‌العملی را نشان می‌دهند، به منظور برنامه‌ریزی اقتصادی در زمینه کاربردی برای سیاست‌گذاران اقتصادی نیز حائز اهمیت است.

لذا این بررسی بخصوص در کشور ما که سیاست‌های پولی دولت منجر به افزایش سطح عمومی قیمت‌ها و یا تورم می‌شود و سالیان بسیار تورم‌گریبان اقتصاد آن است اهمیت بیشتری دارد.

اهداف پژوهش

- بررسی و تعیین جهت علیت رابطه بلندمدت بین عرضه پول و تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی ایران.
- بررسی و تعیین جهت علیت رابطه بلندمدت بین عرضه پول و تولید ناخالص داخلی در مجموع اقتصاد رسمی و غیررسمی در ایران.
- بررسی و مقایسه جهت علیت رابطه بلندمدت بین عرضه پول و تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی کشورهای منتخب عضو اپک^۱ با ایران.

فرضیه‌ها و سؤالات پژوهش

- بین عرضه اسمی پول و تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی و مجموع آن (اقتصاد رسمی و غیررسمی) در ایران، در بلندمدت رابطه مثبت و معنی‌داری وجود دارد.
- بین نرخ رشد عرضه پول و نرخ رشد GDP در اقتصاد رسمی و مجموع آن (اقتصاد رسمی و غیررسمی) در ایران، در بلندمدت رابطه مثبت و معنی‌داری وجود دارد.
- بین عرضه اسمی پول و تولید ناخالص داخلی در اقتصاد رسمی کشورهای عضو اپک، در بلندمدت رابطه مثبت و معنی‌داری وجود دارد.

نوع مطالعه و روش پاسخگویی به فرضیه‌ها و سؤالات پژوهش

مطالعه حاضر به لحاظ هدف از نوع تحقیقات کاربردی بوده و روش جمع‌آوری آمار و اطلاعات به صورت اسنادی و کتابخانه‌ای است. در این مطالعه ابتدا با استفاده از روش کتابخانه‌ای آمار و اطلاعات، مباحث تئوریک و پیشینه تحقیق جمع‌آوری و سپس با در نظر گرفتن ملاحظات و شرایط اقتصادی، مدل و الگوی مناسب اقتصادسنجی اتخاذ می‌گردد. رابطه علیت بین تولید ناخالص داخلی و عرضه پول در اقتصاد رسمی و مجموع اقتصاد رسمی و غیررسمی در ایران از طریق رویکردهای مدل خود توضیح برداری در داده‌های سری زمانی (VAR)، آزمون‌های ریشه واحد (Unit root tests)، آزمون هم‌انباشتگی جوهانسون و آزمون علی-گرنجری مورد بررسی قرار گرفته است.

جامعه آماری و حجم نمونه

بر اساس اهداف اصلی این پژوهش جامعه آماری این تحقیق کشور ایران می‌باشد، همچنین در راستای اهداف تحقیق و به منظور مقایسه نتایج به دست آمده با کشورهای که ساختار اقتصادی مشابه ایران دارند، جامعه آماری مورد بررسی ۱۲ کشور منتخب اپک (ایران، الجزایر، عراق، کویت، لیبی، نیجریه، قطر، عربستان، امارات متحده، اکوادور، انگولا و ونزوئلا) می‌باشد. نمونه و روش نمونه‌گیری در این تحقیق وجود نداشته است و بر اساس اهداف پژوهش، مجموعه داده‌ها شامل سری زمانی سالانه از نقدینگی، تولید ناخالص داخلی واقعی، حجم اقتصاد غیررسمی در ایران در طول بازه زمانی ۱۳۴۵ تا ۱۳۹۲ و داده‌های مربوط به تولید ناخالص داخلی و عرضه پول دوازده کشور منتخب اپک در بازه زمانی ۱۹۹۹ تا ۲۰۱۴ می‌باشد.

^۱- OPEC

ابزار گردآوری داده‌ها

روش جمع‌آوری اطلاعات، کتابخانه‌ای است که با استفاده آمار و اطلاعات برگرفته از مرکز آمار ایران، بانک مرکزی و سایت‌های معتبر خارجی همچون WDI و IMF می‌باشد.

ابزار تجزیه و تحلیل داده‌ها

در این پژوهش با استفاده از روش‌های اقتصادسنجی و نرم‌افزارهای (Eviews) و (Stata)، داده‌های جمع‌آوری شده از سایت بانک مرکزی و مرکز آمار تجزیه و تحلیل شده و معادله مربوطه برآورد می‌گردد.

نوآوری و تفاوت با مطالعات قبلی

تفاوت این مطالعه با سایر مطالعات انجام گرفته در ایران این است که بر اساس بررسی‌های پژوهشگر، تاکنون هیچ مطالعه‌ای در زمینه رابطه علیت بین عرضه پول و تولید ناخالص داخلی با استفاده از روش‌های اقتصادسنجی به کاررفته در این تحقیق انجام نگرفته است این مطالعه از لحاظ به کارگیری این تکنیک‌های اقتصادسنجی دارای نوآوری است، تفاوت بعدی این تحقیق با تحقیقات قبلی در نظر گرفتن بخش غیررسمی اقتصاد در کنار بخش رسمی اقتصاد است که تاکنون نه در ایران و نه دیگر کشورها رابطه مربوطه با حضور بخش غیررسمی اقتصاد بررسی نشده است.