



بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران

مجموعه پژوهشهای اقتصادی

اداره بررسیها و سیاستهای اقتصادی

شماره ۳۹

نظم‌های آماری بخش واقعی در اقتصاد ایران (۸۵-۱۳۶۸)

سال ۱۳۸۸

مؤلف: علی معروف‌خانی

مندرجات این مقاله لزوماً بازگوکننده نظرات بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران نیست.

نقل مطالب این مجموعه با ذکر ماخذ مجاز است.

نشانی پایگاه اطلاع‌رسانی: پژوهش‌ها/نشریات و پژوهش‌ها/<http://www.cbi.ir>

فهرست عناوین

پیشگفتار

چکیده

- ۱- مقدمه..... ۱
- ۲- مقایسه شاخص‌های کلان ایران با کشورهای منطقه..... ۳
 - ۲-۱- مقایسه شاخص‌های کلان با کشورهای حوزه سند چشم‌انداز..... ۳
 - ۲-۲- مقایسه شاخص‌های کلان کشورهای منا MENA..... ۶
 - ۲-۳- مقایسه شاخص‌های منتخب اقتصادی ایران با کشورهای عمده رقیب..... ۷
- ۳- عملکرد رشد اقتصادی در ایران..... ۱۰
 - ۳-۱- رشد اجزای تولید ناخالص داخلی..... ۱۴
 - ۳-۲- رشد اجزای هزینه ناخالص داخلی..... ۱۹
- ۴- اجزای ساختاری (رشد) تولید و هزینه ناخالص..... ۲۴
 - ۴-۱- اجزای ساختاری (رشد) زیربخش‌های اقتصادی..... ۲۵
- ۵- اجزای ساختاری (سیکل) تولید و هزینه ناخالص..... ۲۸
- ۶- روند بیکاری و رشد اقتصادی..... ۳۲
- ۷- همبستگی اجزای تولید و هزینه ناخالص داخلی..... ۳۵
- ۸- شاخص ضمنی تولید..... ۳۸
- ۹- درآمدهای نفتی، مصرف انرژی و رشد اقتصادی..... ۳۹
- ۱۰- پس‌انداز ملی..... ۴۲
- ۱۱- تشکیل سرمایه ثابت ناخالص داخلی..... ۴۶
- ۱۲- شکاف پس‌انداز- سرمایه‌گذاری..... ۵۱
- ۱۳- وضعیت موجودی انبار..... ۵۳
- ۱۴- صادرات و واردات (تجارت برون‌مرزی)..... ۵۴
 - ۱۴-۱- وضعیت صادرات غیر نفتی..... ۵۴
 - ۱۴-۲- وضعیت واردات..... ۵۷
 - ۱۴-۳- رابطه مبادله..... ۶۰
- ۱۵- نسبت باز بودن اقتصاد..... ۶۲
- جمع‌بندی و نتیجه‌گیری..... ۶۳
- منابع و مأخذ..... ۶۸

پیشگفتار

رشد و توسعه اقتصادی پایدار از اصلی‌ترین اهداف اقتصادی کشورها به شمار می‌آید. تأمین این هدف اساسی، مستلزم برنامه‌ریزی جامع، به‌کارگیری ابزارهای مناسب و اتخاذ سیاست‌های هماهنگ و سازگار در بخش‌های مختلف اقتصادی می‌باشد. در این میان، رفع مشکلات بخش واقعی و شناسایی موانع و تنگناهای تولید از اقدامات مهم جهت اصلاح ساختار این بخش و افزایش سرمایه‌گذاری و تولید در کشور می‌باشد.

بر این اساس، جهت شناسایی موانع تولید و آشنایی با واقعیت‌های بخش واقعی، ترکیب بخش‌ها و محدودیت‌های سرمایه‌گذاری در کشور و نظایر آن، استخراج شاخص‌های کلان بخش واقعی صورت گرفته است. با توجه به حجم و ماهیت گزارش به مبانی نظری کمتر اشاره شده، لذا، واقعیت‌ها و متغیرهای کلان بخش واقعی از نگاه آماری (شناخت stylized facts) تحلیل و بررسی شده است.

این گزارش یک کار مقایسه‌ای است که با استفاده از مشخصه‌های آماری و سری زمانی سال‌های ۱۳۶۸-۸۵ در صدد نشان دادن واقعیت‌ها و روندهایی است که درون متغیرهای کلان بخش واقعی به ویژه رشد اقتصادی و اجزای آن نهفته است.

در واقع، هدف اصلی گزارش، انعکاس یکسری شکاف‌ها و کمبودهای ناشی از تنگناهای بخش واقعی اقتصاد است که در مقایسه با سایر کشورها محسوس می‌باشند. کشورهایی که جهت مقایسه انتخاب شده‌اند، کشورهای مورد نظر سند چشم‌انداز و حوزه منا (MENA) بوده و برخی شاخص‌های کلان کشورهای عمده رقیب در منطقه که تقریباً هم‌ساختار با ایران هستند نیز مقایسه شده‌اند. این مقایسه صرفاً از منظر شاخص‌های کمی صورت گرفته است. اما، یقیناً شاخص‌های کیفی هم می‌توانند در مقایسه مزبور موثر باشند.

این پژوهش توسط آقای **علی معروف‌خانی** در اداره بررسی‌ها و سیاست‌های اقتصادی تهیه شده است.

چکیده

نتیجه عملکرد سیاست‌های اقتصادی و غیراقتصادی کشور نهایتاً در بخش واقعی عینیت می‌یابد. بر این اساس، علاوه بر موانع و تنگناهای این بخش نظیر عدم وجود بهره‌وری و کارایی در نیروی انسانی، سرمایه و تکنولوژی و همچنین ساختار هزینه‌ای بنگاه‌های تولیدی، نوسانات و عدم تعادل‌های کلان اقتصادی در بخش‌های پولی و ارزی و بی‌انضباطی مالی دولت که عمدتاً ناشی از درآمدهای سرشار و پرنوسان نفت می‌باشد نیز در بروز مشکلات بخش واقعی موثر می‌باشند.

در مطالعه حاضر، شاخص‌های کلان اقتصادی ایران با کشورهای منطقه در سال‌های ۲۰۰۰-۰۶ میلادی مورد مقایسه قرار گرفته و با استفاده از آمار حساب‌های ملی سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ تحلیل روند، سیکل، ضرایب همبستگی و سایر مشخصه‌های آماری رشد تولید ناخالص داخلی و اجزای آن صورت گرفته است.

بررسی شاخص‌های کلان بخش واقعی طی دوره مورد بررسی نشان می‌دهد علی‌رغم اینکه سطح متغیرهای انتخاب شده در ایران بالاست، رشد و سرانه آن در مقایسه با کشورهای منطقه منا و حوزه سند چشم‌انداز مطلوب نمی‌باشد. علاوه بر این، متوسط رشد تولید ناخالص داخلی (که معمولاً جهت ارائه تصویری کلی از وضعیت اقتصادی کشور به آن استناد می‌شود) حدود ۵/۲ درصد بوده که نسبتاً مناسب می‌باشد. اما، ضریب پراکندگی آن زیاد است و بیانگر نوسان و بی‌ثباتی رشد می‌باشد.

علاوه بر عدم ثبات روند متغیرها و نامطلوب بودن روند مصرف و سرمایه‌گذاری، وابستگی زیادی به درآمد نفت و واردات جهت تداوم تولید وجود دارد. همچنین به دلیل ارزان بودن قیمت انرژی در کشور سرانه مصرف آن برای تولید یک واحد از تولید ناخالص داخلی روند افزایشی داشته و شدت مصرف انرژی در ایران در مقایسه با کشورهای جهان بسیار بالاست.

کلمات کلیدی: نظم‌های آماری (stylized facts)، بخش واقعی، شاخص‌های کلان و رشد اقتصادی.

۱- مقدمه

بسیاری از موانع و مشکلات بخش واقعی به ساختار هزینه‌های بنگاه‌های تولیدی و عدم وجود کارایی و بهره‌وری در نیروی انسانی، سرمایه و تکنولوژی آن و همچنین عدم تناسب فعالیت‌های تولیدی و مولد با بخش خدمات مربوط است. به رغم این، عدم تعادل‌های کلان اقتصادی در حوزه‌های پولی، مالی و ارزی و همچنین، عدم وجود بازارهای سرمایه قوی که موجب هدایت پس‌اندازهای جامعه به سمت فعالیت‌های تولیدی و مولد شود نیز در بروز مشکلات بخش واقعی مؤثر است.

علاوه بر این، بسیاری از مسائل سیاسی در روابط خارجی و همچنین شوک‌های بین‌المللی نظیر نوسانات جهانی قیمت نفت و تغییر قیمت کالاهای صادراتی و مواد اولیه، واسطه‌ای و سرمایه‌ای وارداتی و امثال آن از مسائل تأثیرگذار بر فرآیند تولید در کشور بوده و ملاحظات مربوطه می‌بایست در تدوین مشکلات بخش واقعی مدنظر قرار گیرند.

این گزارش با استفاده از اطلاعات سال‌های ۰۶-۲۰۰۰ میلادی، شاخص‌های کلان اقتصادی ایران با کشورهای منطقه را مورد مقایسه قرار داده و با بهره‌گیری از آمار سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ اداره حساب‌های اقتصادی به بررسی متغیرهای کلان بخش واقعی کشور پرداخته است.

مقایسه شاخص‌های کلان اقتصادی با کشورهای منطقه نشان می‌دهد، علی‌رغم اینکه سطح متغیرهای انتخاب شده نظیر تولید ناخالص، تشکیل سرمایه ثابت و نظایر آن در ایران بالاست، لیکن رشد و وضعیت سرانه آنها مناسب نبوده و حاکی از وضعیت نسبتاً نامطلوب در کشور می‌باشد.

تولید ناخالص داخلی (GDP) و رشد آن از متغیرهای اساسی است که روند کلی حرکت اقتصاد کشور

را نشان می‌دهد. همچنین، اجزای تولید و هزینه ناخالص داخلی بیانگر تحولات درون‌بخشی و ساختار تولید و هزینه کشور بوده و در شکل‌گیری مناسبات و برنامه‌ریزی‌های آتی بخش واقعی نقش اساسی ایفا می‌نمایند.

بر این اساس، مشخصه‌های آماری رشد اقتصادی و اجزای آن نظیر میانگین، انحراف معیار، ضریب پراکندگی و امثال آن در طول برنامه‌های اول تا چهارم (۲ سال اول برنامه) توسعه اقتصادی کشور مورد بررسی قرار گرفته است. مطابق محاسبات صورت گرفته، رشد متوسط تولید ناخالص سالانه حدود ۵/۲ درصد بوده که نسبتاً مناسب به نظر می‌رسد. اما، ضریب پراکندگی^۱ آن بالا بوده که حاکی از نوسان و بی‌ثباتی رشد، به ویژه در برنامه‌های اول و دوم توسعه می‌باشد.

در ادامه گزارش، اجزای ساختاری (روند و سیکل) تولید و هزینه ناخالص و زیربخش‌های آن و همبستگی پیشین و پسین^۲ بخش‌های اقتصادی و ضرایب همبستگی مربوطه تحلیل و محاسبه شده است. علاوه بر این، بررسی رابطه درآمدهای نفتی و رشد اقتصادی، وضعیت پس‌انداز و تشکیل سرمایه ثابت، تغییر در موجودی انبار و همچنین، وضعیت واردات و صادرات از سایر بخش‌های مورد مطالعه می‌باشد. بررسی‌ها نشان می‌دهند علی‌رغم اینکه متغیرهایی نظیر مصرف (خصوصی و دولتی) از ثبات نسبی برخوردار بوده است رشد اقتصادی و سرمایه‌گذاری ثبات کمتری داشته‌اند. همچنین، علاوه بر عدم ثبات روندها و نامطلوب بودن روند مصرف و سرمایه‌گذاری، وابستگی زیادی به درآمد نفت و واردات جهت تداوم تولید وجود دارد.

نرخ بیکاری و روند آن از دیگر متغیرهای مهمی است که با توجه به رشد فزاینده عرضه نیروی کار و رابطه شکاف بیکاری و شکاف تولید مورد بررسی قرار گرفته است.

۱- ضریب پراکندگی در این گزارش از نسبت انحراف معیار به میانگین به دست آمده است.

۲- Lead and Lag

۲-۲- مقایسه شاخص‌های کلان اقتصادی ایران با کشورهای منطقه

بررسی شاخص‌های کلان اقتصادی ایران و مقایسه آن با شاخص‌های مشابه در کشورهای منطقه موقعیت فعلی اقتصاد ایران در منطقه را روشن ساخته و به سیاست‌گذاری مناسب و برنامه‌ریزی صحیح در جهت دستیابی به اهداف مورد نظر سند چشم‌انداز کمک می‌کنند. بر این اساس در این گزارش، مقایسه شاخص‌های مذکور با کشورهای حوزه سند چشم‌انداز ۲۰ ساله^۱، کشورهای حوزه منا^۲ و کشورهای عمده رقیب در منطقه صورت گرفته است.

۲-۱- مقایسه شاخص‌های کلان با کشورهای حوزه سند چشم‌انداز

مقایسه شاخص‌های کلان اقتصادی با کشورهای مورد نظر حوزه سند چشم‌انداز ۲۰ ساله جمهوری اسلامی ایران نشان می‌دهد، علی‌رغم اینکه سطح متغیرهای انتخاب شده نظیر تولید ناخالص داخلی، تشکیل سرمایه ثابت و نظایر آن در ایران بالاست، لیکن رشد این متغیرها و وضعیت سرانه آن مناسب نبوده و حاکی از وضعیت نسبتاً نامطلوب در کشور می‌باشد. به گونه‌ای که در اغلب شاخص‌ها، کشور ایران از رتبه پایین‌تری برخوردار می‌باشد.

به عنوان مثال، ارزش تولید ناخالص داخلی بر اساس قدرت خرید^۳ در ایران در سال ۲۰۰۵ حدود ۴/۲ برابر بالاتر از میانگین کشورهای منطقه بوده و در جایگاه دوم (پس از کشور ترکیه) قرار دارد که موقعیت ممتازی به حساب می‌آید. اما در این سال، رتبه کشور از نظر شاخص تولید ناخالص داخلی سرانه براساس PPP در بین کشورهای منطقه در رده دهم قرار داشته و مقدار آن تقریباً ۱۸ درصد پایین‌تر از میانگین منطقه بوده است. علت اصلی آن، جمعیت نسبتاً بالای کشور در مقایسه با کشورهای منطقه و پایین بودن میزان تولید به نسبت جمعیت می‌باشد.

۱- کشورهای حوزه سند چشم‌انداز ۲۰ ساله جمهوری اسلامی ایران عبارتند از: ایران، عربستان سعودی، ترکیه، پاکستان، مصر، رژیم اشغالگر قدس، امارات متحده عربی، کویت، عراق، قطر، اردن، بحرین، سوریه، فلسطین، لبنان، یمن، عمان، آذربایجان، ازبکستان، تاجیکستان، ترکمنستان، گرجستان، قزاقستان، قرقیزستان، ارمنستان و افغانستان.

۲- Middle East and North Africa (MENA)

۳- Purchasing Power Parity (PPP)

در سال ۲۰۰۵، سهم ایران از کل تولید ناخالص جهانی بر اساس برابری قدرت خرید حدود ۴/۱ برابر بیشتر از میانگین منطقه بوده در میان کشورهای منطقه، رتبه دوم را احراز کرده است که بیانگر بالاتر بودن حجم و سهم بیشتر اقتصاد ایران در تولید جهانی در مقایسه با سایر کشورهای منطقه می‌باشد. این وضعیت در خصوص نسبت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تولید ناخالص داخلی نیز قابل ملاحظه بوده و میزان آن در این سال ۱/۲ برابر بیشتر از میانگین منطقه شده و سبب گردیده تا ایران رتبه چهارم را در بین کشورهای منطقه داشته باشد. لیکن، رشد تشکیل سرمایه کشور حدود ۳۱ درصد پایین‌تر از میانگین منطقه بود و ایران در میان کشورهای منطقه در رتبه هشتم قرار گرفت.

رتبه شاخص های کلیدی اقتصاد ایران در بین کشورهای منطقه (۱)

ردیف	شاخص	میانگین منطقه	بالاترین در منطقه	پایین ترین در منطقه	رتبه منطقه ای	میزان اختلاف با میانگین کشورهای منطقه
۱	شاخص آزادی اقتصادی - سال ۲۰۰۵	۳/۳	۴/۴	۲/۱	۲	۱،۳ واحد بالاتر از میانگین
۲	رشد سالانه تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۵	۹/۲	۴۷	-۱	۲۰	۵۶،۴ درصد پایین تر از میانگین
۳	ارزش تولید ناخالص داخلی بر اساس برابری قدرت خرید (PPP) - سال ۲۰۰۵	۱۳۲/۸	۶۱۱/۴	۸/۶	۲	۴،۲ برابر بالاتر از میانگین
۴	تولید ناخالص داخلی سرانه (بر اساس PPP) - سال ۲۰۰۵	۹۸۵۰	۳۱۶۶۳	۷۳۹	۱۰	۱۸ درصد پایین تر از میانگین
۵	سهم تولید ناخالص داخلی از تولید ناخالص داخلی جهانی (بر اساس برابری قدرت خرید) - سال ۲۰۰۵	۰/۲۲	۱	۰/۰۱	۲	۴،۲ برابر بیشتر از میانگین
۶	سهم ارزش افزوده بخش کشاورزی از تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۳	۱۳/۹	۳۳/۲	۰/۸	۸	۲ درصد پایین تر از میانگین
۷	سهم ارزش افزوده صنایع کارخانه ای از تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۳	۱۲/۲	۱۹/۸	۳/۲	۳	۱،۴ برابر بالاتر از میانگین
۸	رشد تشکیل سرمایه ثابت ناخالص - سال ۲۰۰۵	۸/۷	۳۲	-۳/۰	۸	۳۱ درصد پایین تر از میانگین
۹	نسبت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۵	۲۲/۵	۳۶	۱۳	۴	۱،۲ برابر بیشتر از میانگین
۱۰	سهم بخش خارجی از تجارت جهانی - سال ۲۰۰۴	۰/۲۳	۰/۹۵	۰/۰۱	۵	۲،۱ برابر بیشتر از میانگین
۱۱	باز بودن اقتصاد (صادرات (با نفت) + واردات تقسیم بر GDP جاری) - سال ۲۰۰۴	۹۰/۴	۱۴۷/۶	۳۰/۹	۱۹	۳۲ درصد پایین تر از میانگین
۱۲	کل بدهی خارجی - سال ۲۰۰۵	۲۱/۳	۱۷۱	۱	۶	۱،۴ درصد پایین تر از میانگین
۱۳	نسبت بدهی خارجی به تولید ناخالص داخلی	۴۱/۶	۳۰۵	۲/۷	۶	۲۹ درصد پایین تر از میانگین
۱۴	تراز حساب جاری - سال ۲۰۰۵	۶/۴	۹۰/۸	-۲۲/۷	۴	۲،۲ برابر بالاتر از میانگین
۱۵	نسبت تراز حساب جاری به تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۵	۲/۱	۴۰	-۱۸	۴	۴،۲ برابر بالاتر از میانگین
۱۶	نرخ تورم - سال ۲۰۰۵	۷/۱	۲۱	-۰/۷	۳	۱،۷ برابر بیشتر از میانگین
۱۷	نرخ بهره سپرده گذاری - سال ۲۰۰۵	۷	۲۰	۱	۳	۱،۷ برابر بیشتر از میانگین
۱۸	نسبت نقدینگی به تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۵	۵۵/۲	۲۲۰	۷	۱۲	۳۸،۴ درصد پایین تر از میانگین
۱۹	جمعیت - سال ۲۰۰۵	۲۳/۲	۱۵۵/۸	۰/۷	۴	۲،۹ برابر بیشتر از میانگین
۲۰	نسبت سرمایه گذاری مستقیم خارجی به تولید ناخالص داخلی - سال ۲۰۰۳	۴/۲	۴۶	-۰/۲	۱۸	۹۳ درصد پایین تر از میانگین
۲۱	سرمایه گذاری مستقیم خارجی ورودی هر کشور به کل سرمایه گذاری مستقیم خارجی - سال ۲۰۰۴	۰/۱۵	۰/۷۴	-۰/۰۰۳	۱۲	۴۸ درصد پایین تر از میانگین
۲۲	ضریب جینی - سال ۲۰۰۳	۰/۳۵۵	۰/۴۳	۰/۲۶۸	۱	۱،۲ برابر بالاتر از میانگین
۲۳	مصرف سرانه انرژی برق - سال ۲۰۰۴	۴۱۰۹/۷	۱۵۸۵۳	۱۶۵	۱۲	۵۰ درصد پایین تر از میانگین

۱- بالاترین رتبه لزوماً به معنای بهترین وضعیت ارزیابی نمی شود. در واقع ارزشیابی جایگاه رتبه ای کشور بسته به ماهیت متغیرها متفاوت است. به عنوان مثال داشتن رتبه بالا در خصوص تولید ناخالص داخلی مثبت و در خصوص نرخ تورم، منفی ارزیابی می شود.

۲-۲- مقایسه شاخص‌های کلان کشورهای منا

مقایسه شاخص‌های کلان اقتصادی نظیر رشد اقتصادی، بیکاری و تورم در کشورهای حوزه منا در سال ۲۰۰۶ نیز نشان می‌دهد که ایران دارای نرخ تورم و بیکاری بالاتر از مقدار میانگین کشورهای منطقه بوده و در مقابل از نرخ رشد اقتصادی پایین‌تری برخوردار می‌باشد.

در میان ۱۱ کشور منطقه منا^۱، نرخ بیکاری در ایران، پس از کشورهای الجزایر و اردن (در رتبه سوم) قرار داشته و پس از کشور یمن، ایران دارای بالاترین نرخ تورم در سال ۲۰۰۶ بوده است. در حالی که با توجه به نرخ رشد بالای جمعیت در گذشته که منجر به افزایش جمعیت جوان کشور شده، می‌بایست اشتغال بیشتری ایجاد شود تا شاخص‌های مربوطه بهبود یابند.

علاوه بر نرخ تورم و بیکاری بالا، نرخ رشد اقتصادی ایران در مقایسه با سایر کشورها پایین بوده و پس از نرخ رشد کشورهای قطر، امارات، مراکش، بحرین، مصر و اردن در رتبه هفتم قرار دارد. این در حالی است که ایران دارای منابع طبیعی و ثروت‌های بلااستفاده فراوان بوده و از بعد زمانی نیز فرآیند رشد و توسعه اقتصادی خود را قبل از کشورهای مزبور آغاز نموده است.

مقایسه شاخص‌های کلان اقتصادی کشورهای MENA

(درصد، تولید اسمی بر حسب میلیارد دلار)

کشور	رشد اقتصادی	رشد تولید سرانه	تولید اسمی	نرخ تورم	نرخ بیکاری
الجزایر	۱،۴	۰،۲	۱۱۲	۲،۲	۱۵،۳
اردن	۶،۳	۳،۹	۱۴	۶،۱	۱۴،۸
ایران	۶،۲	۳،۴	۲۱۹	۱۱،۹	۱۱،۲
مراکش	۷،۳	۶،۳	۵۷	۳،۱	۱۱،۰
یمن	۳،۹	۰،۸	۱۷	۱۵،۷	۱۰،۲
مصر	۶،۹	۴،۴	۱۰۷	۷،۷	۸،۳
عربستان	۵،۸	۲،۹	۳۶۹	۲،۲	۷،۰
امارات	۱۰،۷	۳،۳	۱۷۷	۶،۰	۳،۰
قطر	۱۲،۱	۹،۷	۴۷	۷،۰	۲،۱
بحرین	۷،۰	۴،۹	۱۶	۳،۴	۱،۹
سوریه	۵،۱	۲،۷	۲۸	۶،۰	-

توضیح: ارقام ایران برای سال ۱۳۸۵ و سایر ارقام مربوط به سال ۲۰۰۶ می‌باشد.

ماخذ: گزارش بانک جهانی سال ۲۰۰۷

۱- کشورهای حوزه منا عبارتند از: اردن، الجزایر، امارات متحده عربی، ایران، بحرین، سوریه، عربستان سعودی، قطر، مراکش، مصر و یمن.

۳-۲- مقایسه شاخص‌های منتخب اقتصادی ایران با کشورهای عمده رقیب

بررسی روند رشد و پیشرفت اقتصادی ۵ کشور رقیب اصلی و بالقوه منطقه که در برخی از شاخص‌های عمده و اساسی دارای برتری نسبی بوده و از ظرفیت و توانایی‌های اقتصادی بالایی برخوردار هستند (شامل عربستان سعودی، ترکیه، پاکستان، مصر و رژیم اشغالگر قدس)، طی دوره ۲۰۰۵-۲۰۰۰ بیانگر وضعیت نه چندان مناسب شاخص‌های منتخب اقتصادی در ایران می‌باشد.

علی‌رغم اینکه رشد اقتصادی ایران طی سال‌های مورد اشاره همواره مثبت بوده و تا سال ۲۰۰۲ روند صعودی داشته، لیکن به تدریج از میزان رشد آن کاسته شده است. به گونه‌ای که در سال ۲۰۰۵ که اولین سال دوره زمانی موردنظر سند چشم‌انداز می‌باشد، رشد اقتصادی ایران در میان سایر کشورهای منطقه در رتبه آخر قرار گرفته است.

علاوه بر این، بررسی متغیرهایی نظیر نسبت تشکیل سرمایه به تولید ناخالص داخلی و رشد تشکیل سرمایه نشان می‌دهد که طی سال‌های ۲۰۰۰ تا ۲۰۰۵ نسبت مزبور در ایران همواره بالاتر از سایر کشورها بوده و بین ۲۶ تا ۲۸ درصد در نوسان بوده است. همچنین، رشد تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در ایران در سال‌های ابتدای دوره بالاتر از کشورهای منطقه بوده، لیکن پس از سال ۲۰۰۱ روند کاهنده یافته و پایین‌تر از رشد کشورهای نظیر ترکیه و مصر قرار گرفته است. کاهش رشد مزبور و بهره‌وری می‌تواند از دلایل کاهنده بودن رشد تولید ناخالص در سال‌های اخیر باشد.

بدین ترتیب، لازم است که برنامه‌ریزی مناسب جهت افزایش سرمایه‌گذاری و بهره‌وری تولید در کشور صورت گیرد. در این میان، توجه به جذب هرچه بیشتر سرمایه‌گذاری خارجی و استفاده از منابع سرشار و بلااستفاده کشور و همچنین، کارایی و توان‌مندی بالای بخش خصوصی در کنار نظارت‌های مناسب دولت از عوامل مهمی است که در این برنامه‌ریزی هدفمند فرآیند توسعه اقتصادی می‌بایست مدنظر سیاست‌گذاران و مسئولین امر قرار گیرد.

(درصد)

رشد تولید ناخالص داخلی

سال						کشور
۲۰۰۵	۲۰۰۴	۲۰۰۳	۲۰۰۲	۲۰۰۱	۲۰۰۰	
۴ ^(۱)	۵	۷	۸	۴	۵	ایران
۷	۵	۸	۰	۱	۵	عربستان سعودی
۷	۹	۶	۸	-۷	۷	ترکیه
۸	۶	۵	۳	۲	۴	پاکستان
۵	۴	۳	۳	۴	۵	مصر
۵	۴	۲	-۱	۰	۸	رژیم اشغالگر قدس

منبع: World Development Indicators, ۲۰۰۷

(۱) براساس محاسبات ملی انجام شده توسط بانک مرکزی ج.ا.ا این نرخ رشد معادل ۴/۵ درصد می‌باشد.

(دلار)

تولید ناخالص داخلی سرانه بر اساس برابری قدرت خرید

سال						کشور
۲۰۰۵	۲۰۰۴	۲۰۰۳	۲۰۰۲	۲۰۰۱	۲۰۰۰	
۷,۹۶۸	۷,۵۱۴	۷,۰۶۵	۶,۵۴۸	۶,۰۷۹	۵,۸۰۴	ایران
۱۵,۷۱۱	۱۴,۶۸۵	۱۳,۹۵۸	۱۳,۰۵۴	۱۳,۱۷۰	۱۳,۱۵۰	عربستان سعودی
۸,۴۰۷	۷,۶۹۸	۶,۹۲۹	۶,۵۱۹	۶,۰۳۰	۶,۴۷۰	ترکیه
۲,۳۷۰	۲,۱۸۷	۲,۰۵۲	۱,۹۶۳	۱,۹۱۵	۱,۸۸۰	پاکستان
۴,۳۳۷	۴,۰۸۹	۳,۸۹۸	۳,۷۷۷	۳,۶۶۷	۳,۵۲۶	مصر
۲۵,۸۶۴	۲۴,۲۹۴	۲۳,۰۵۲	۲۲,۶۱۴	۲۲,۹۵۲	۲۳,۰۰۶	رژیم اشغالگر قدس

منبع: World Development Indicators, ۲۰۰۷

(درصد)

نسبت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تولید ناخالص داخلی

سال						کشور
۲۰۰۵	۲۰۰۴	۲۰۰۳	۲۰۰۲	۲۰۰۱	۲۰۰۰	
۲۷	۲۹	۲۹	۲۸	۲۸	۲۶	ایران
۱۵	۱۷	۱۸	۱۸	۱۸	۱۷	عربستان سعودی
۲۰	۱۸	۱۵	۱۷	۱۸	۲۲	ترکیه
۱۵	۱۶	۱۵	۱۵	۱۶	۱۶	پاکستان
۱۸	۱۶	۱۶	۱۸	۱۸	۱۹	مصر
۱۸	۱۸	۱۸	۱۹	۱۹	۲۰	رژیم اشغالگر قدس

منبع: World Development Indicators, ۲۰۰۷

(درصد)

نرخ تورم^(۱)

سال						کشور
۲۰۰۵	۲۰۰۴	۲۰۰۳	۲۰۰۲	۲۰۰۱	۲۰۰۰	
۱۳	۱۵	۱۶	۱۴	۱۱	۱۴	ایران
۱	۰	۱	۰	-۱	-۱	عربستان سعودی
۸	۹	۲۵	۴۵	۵۴	۵۵	ترکیه
۹	۷	۳	۳	۳	۴	پاکستان
۵	۱۱	۵	۳	۲	۳	مصر
۱	۰	۱	۶	۱	۱	رژیم اشغالگر قدس

منبع: World Development Indicators, ۲۰۰۷

۱- نرخهای گزارش شده توسط نشریه فوق‌الذکر درخصوص ایران، اندکی با ارقام بانک مرکزی متفاوت است.

(درصد)

نرخ بیکاری

سال						کشور
۲۰۰۵	۲۰۰۴	۲۰۰۳	۲۰۰۲	۲۰۰۱	۲۰۰۰	
..	..	۱۲	۱۳	۱۴	۱۴	ایران
..	۵	۵	۵	عربستان سعودی
۱۰	۱۰	۱۱	۱۰	۸	۷	ترکیه
..	۸	..	۸	..	۷	پاکستان
..	..	۱۱	۱۰	۹	۹	مصر
..	..	۱۱	۱۰	۹	۹	رژیم اشغالگر قدس

منبع: World Development Indicators, ۲۰۰۷

۳- عملکرد رشد اقتصادی در ایران

بررسی رشد تولید ناخالص داخلی طی دوره مورد بررسی (۸۵-۱۳۶۸) نشان می‌دهد که در طول این سال‌ها، رشد متوسط تولید ناخالص سالانه حدود ۵/۲ درصد بوده که نسبتاً مناسب به نظر می‌رسد. اما، میزان انحراف معیار و ضریب پراکندگی^۱ آن بالا (حدود ۰/۶۷) بوده است که حاکی از نوسان و بی‌ثباتی رشد، به ویژه در برنامه‌های اول و دوم توسعه می‌باشد.

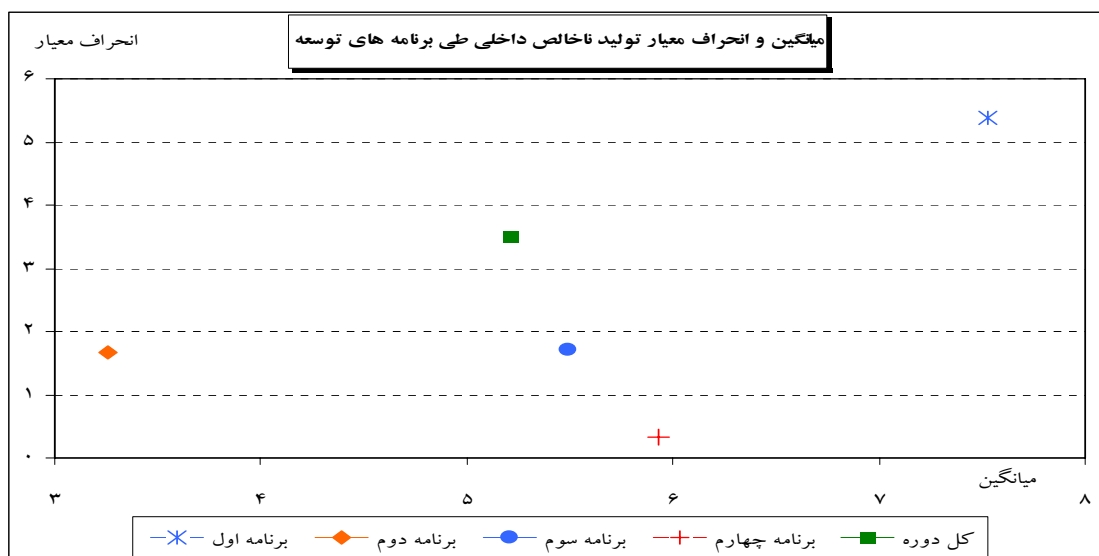
علی‌رغم این، مقایسه رشد متوسط تولید ناخالص داخلی کشور با کشورهای حوزه سند چشم‌انداز در سال‌های اخیر، بیانگر روند کاهنده رشد در ایران می‌باشد. به‌گونه‌ای که در سال ۲۰۰۵ رشد تولید ناخالص داخلی ایران در مقایسه با رشد متوسط ۹/۲ درصدی کشورهای مزبور در سطح پایینی قرار داشته است.

میانگین رشد تولید ناخالص داخلی ایران در طول برنامه‌های اول تا چهارم (۲ سال اول) توسعه اقتصادی، پس از افزایش زیاد در سال‌های ابتدای برنامه اول، دارای روندی کاهنده بوده و از برنامه سوم، مجدداً فزاینده شده است. اما، ضریب پراکندگی رشد در طول برنامه‌های توسعه، روندی کاهنده داشته و با ثبات گردیده است.

با توجه به هدف بازسازی اقتصادی کشور در برنامه پنج‌ساله اول توسعه و استفاده از ظرفیت‌های خالی اقتصاد که به دلیل جنگ تحمیلی راکد مانده بود در سال‌های ابتدای برنامه، میانگین رشد اقتصادی بالا بوده و سبب شد تا در این برنامه رشد تولید به حدود ۷/۴ درصد بالغ گردد. این میزان، بیشترین مقدار رشد در میان برنامه‌های پنج ساله توسعه اقتصادی کشور می‌باشد. لیکن، انحراف معیار و ضریب پراکندگی رشد اقتصادی در این برنامه بسیار بالا بوده (حدود ۰/۷۳) و رشد مزبور را در مقایسه با سایر برنامه‌های توسعه از ثبات کمتری برخوردار ساخته است.

نوسانات نرخ ارز، بروز انتظارات تورمی شدید، سررسید بدهی‌های کوتاه‌مدت و بحران بوجود آمده ناشی از آن و نهایتاً شناورسازی نرخ ارز در سال پایانی برنامه اول از جمله عوامل موثر بر فعالیت‌های اقتصادی و نوسان تولید بوده است. این امر، سبب افزایش تقاضا به ویژه برای کالاهای بادوام گردید. اما به دلیل محدودیت طرف عرضه جهت تامین سریع نیازهای جامعه، سبب فزونی تقاضا بر عرضه و افزایش بی‌ثباتی قیمت‌ها گردیده و در نهایت موجب تسری بی‌ثباتی در همه بخش‌ها شده است.

۱- ضریب پراکندگی در این گزارش از نسبت انحراف معیار به میانگین به دست آمده است.

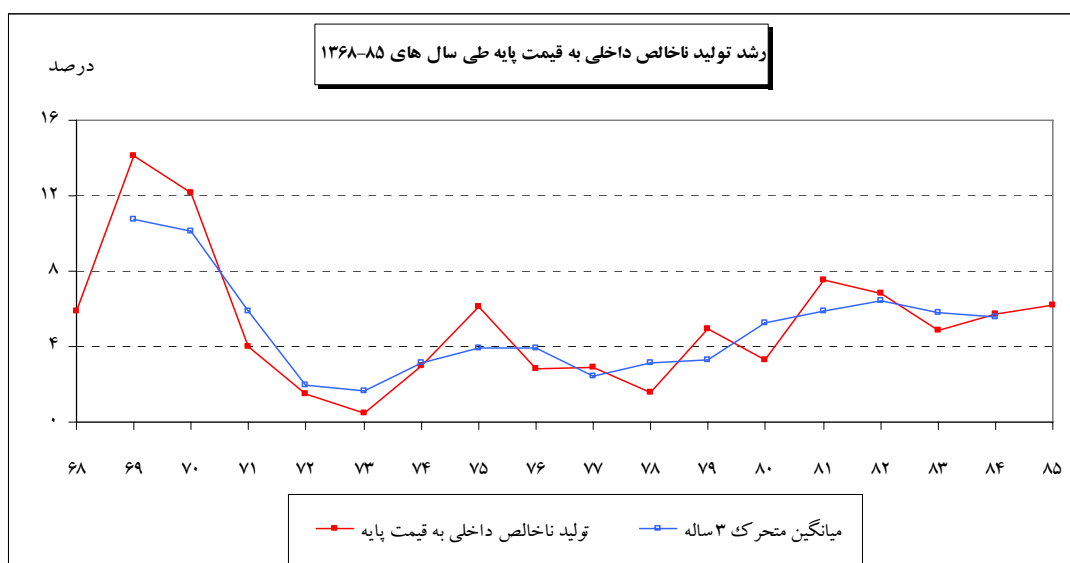


در برنامه دوم توسعه، افزایش تولید از محل استفاده از ظرفیت‌های خالی محدود شد و رشد اقتصادی به سرمایه‌گذاری‌های انجام شده معطوف گردید. علاوه بر این، تغییر رویکرد تثبیت قیمت پس از بحران سال ۱۳۷۴ و بحران ناشی از کاهش قیمت جهانی نفت در سال ۱۳۷۷ موجب شد تا آهنگ رشد اقتصادی در این برنامه به میزان قابل توجهی کاهش یابد. به گونه‌ای که در این دوره، رشد متوسط سالانه تولید در کمترین مقدار خود (به طور متوسط ۳/۲ درصد) قرار گرفته است. گرچه در این برنامه از میزان بی‌ثباتی و نوسان تولید در مقایسه با برنامه اول کاسته شده، لیکن با وجود پایین بودن میانگین رشد، انحراف معیار و ضریب پراکندگی آن در مقایسه با برنامه‌های سوم و چهارم به مراتب بالاتر بوده است.

رشد اقتصادی در سال‌های برنامه سوم و ابتدای برنامه چهارم توسعه از روند نسبتاً باثباتی برخوردار گردیده که حاصل اتخاذ سیاست‌های مناسب در بخش‌های مالی، پولی و ارزی و همچنین ثبات نسبی در روابط خارجی کشور بوده و بخش واقعی اقتصاد را از شرایط پایدارتری برخوردار ساخته است.

افت شدید رشد بخش نفت در سال‌های برنامه دوم توسعه و سال‌های اولیه برنامه سوم (که ناشی از کاهش شدید قیمت نفت و به تبع آن درآمدهای ارزی حاصله در سال ۱۳۷۷ بود)، کاهش رشد بخش ساختمان در سال‌های برنامه دوم و دو سال آخر برنامه سوم و همچنین، کاهش شدید و نوسان زیاد رشد بخش کشاورزی در برخی سال‌های این دوره، عامل اصلی کاهش رشد اقتصادی در سال‌های مزبور و روند ناپایدار آن در ادامه بوده است.

در مجموع می‌توان گفت که بر اساس میانگین متحرک ۳ ساله، رشد اقتصادی کشور پس از نوسانات شدید در برنامه اول از روند نسبتاً باثباتی برخوردار گردیده و از ضریب پراکندگی آن در طول برنامه‌های سوم و چهارم کاسته شده است. به گونه‌ای که بجز کاهش رشد پس از بحران کاهش درآمدهای نفتی در سال ۱۳۷۷ روند صعودی با شیب کاهنده داشته است. شایان ذکر است که در طول دوره مورد بررسی، رشد تولید ناخالص داخلی بدون نفت نیز ۵/۵ درصد بوده که بالاتر از رشد تولید با احتساب نفت می‌باشد.



گرچه وضعیت نیروی کار، سرمایه، تکنولوژی تولید و بهره‌وری در بخش واقعی و همچنین مشکلات و مسائل ساختاری آن عامل اصلی و تاثیرگذار در فرایند رشد می‌باشد، لیکن نوسانات و تحولات سیاست‌گذاری اقتصادی در بخش‌های مالی، پولی و ارزی به ویژه بی‌انضباطی در بخش عملکرد مالی دولت که عمدتاً ناشی از درآمدهای سرشار و پرنوسان نفت می‌باشد در بی‌ثباتی رشد اقتصادی موثر بوده است.

علاوه بر این، مسائل سیاسی در روابط خارجی و نوسانات جهانی قیمت نفت و تغییر قیمت کالاهای صادراتی و مواد اولیه، واسطه‌های و سرمایه‌های وارداتی و نظایر آن از مسائل تأثیرگذار بر فرآیند تولید در کشور بوده و می‌بایست در کنار مشکلات بخش واقعی مدنظر قرار گیرند.

مشخصه های آماری رشد اجزای تولید ناخالص داخلی در برنامه های توسعه (۱)

ضریب پراکندگی					میانگین برنامه					عنوان
چهارم	سوم	دوم	اول	کل	چهارم	سوم	دوم	اول	کل	
۰،۴۷	۱،۲۱	۳،۰۸	۰،۶۶	۱،۱۲	۷،۰	۴،۳	۲،۱	۶،۴	۴،۴	گروه کشاورزی
۰،۹۶	۳،۰۲	-۲،۹۹	۰،۸۶	۲،۷۸	۱،۸	۳،۰	-۱،۳	۸،۹	۲،۸	گروه نفت
۰،۱۸	۰،۱۹	۱،۶۰	۱،۲۸	۱،۰۳	۷،۶	۹،۷	۵،۱	۱۰،۰	۷،۸	گروه صنایع و معادن
۰،۱۷	۰،۸۱	۲،۲۹	۰،۸۹	۰،۹۲	۱۲،۰	۱۱،۱	۳،۶	۱۰،۰	۹،۳	معادن
۰،۲۱	۰،۰۷	۱،۳۹	۱،۷۰	۱،۰۳	۸،۳	۱۱،۲	۶،۵	۸،۷	۸،۴	صنعت
۰،۱۹	۰،۲۳	۰،۱۲	۰،۳۰	۰،۲۸	۷،۴	۷،۶	۶،۹	۱۰،۰	۸،۲	برق ، آب و گاز
۰،۱۳	۱،۶۷	۷،۲۰	۰،۹۵	۲،۰۰	۴،۱	۵،۰	۱،۴	۱۳،۳	۵،۴	ساختمان
۰،۱۱	۰،۲۴	۰،۲۴	۰،۶۰	۰،۴۷	۶،۰	۴،۶	۴،۲	۶،۵	۵،۱	گروه خدمات
۰،۰۵	۰،۱۸	۱،۰۶	۱،۳۹	۰،۹۶	۷،۲	۷،۴	۳،۵	۵،۳	۵،۱	بازرگانی ، رستوران و هتلداری
۰،۳۸	۰،۲۶	۰،۶۹	۰،۷۸	۰،۶۰	۱۰،۹	۵،۴	۸،۸	۸،۰	۷،۹	حمل و نقل ، انبارداری و ارتباطات
۰،۲۰	۰،۲۵	۱،۰۵	۱،۵۸	۰،۸۳	۱۵،۴	۱۴،۴	۶،۴	۴،۷	۸،۷	خدمات موسسات مالی و پولی
۰،۲۱	۰،۸۲	۰،۴۰	۰،۷۲	۰،۹۰	۳،۳	۳،۳	۵،۷	۱۱،۷	۶،۴	خدمات مستغلات و خدمات حرفه ای و تخصصی
۱،۳۰	-۲،۲۲	۲۴،۳۷	۰،۳۸	۲،۵۰	۰،۶	-۰،۸	۰،۲	۴،۴	۱،۲	خدمات عمومی
۰،۱۵	۰،۲۰	۱،۵۰	۴،۳۵	۱،۱۲	۵،۹	۸،۸	۴،۲	۱،۷	۵،۰	خدمات اجتماعی ، شخصی و خانگی
۰،۰۶	۰،۳۱	۰،۵۱	۰،۷۳	۰،۶۸	۵،۹	۵،۵	۳،۲	۷،۴	۵،۲	تولید ناخالص داخلی به قیمت پایه
۰،۰۲	۰،۲۴	۰،۴۵	۰،۷۲	۰،۵۶	۶،۵	۵،۸	۴،۰	۷،۱	۵،۵	تولید ناخالص داخلی به قیمت پایه (بدون نفت)

۱- در همه قسمت های این گزارش، منظور از برنامه چهارم، عملکرد سال های ۱۳۸۴ و ۱۳۸۵ می باشد.

۱-۳- رشد اجزای تولید ناخالص داخلی

در میان زیربخش‌های تولید ناخالص داخلی طی دوره مورد بررسی، گروه صنایع و معادن از بیشترین رشد متوسط برخوردار بوده و در مقایسه با بخش‌های کشاورزی و نفت ضریب پراکندگی کمتری داشت. در مقابل، بخش نفت علی‌رغم اینکه کمترین میزان متوسط رشد را در بین بخش‌های اقتصادی داشت به شدت پرنوسان و بی‌ثبات بود.

در برنامه اول توسعه، گروه صنایع و معادن و زیرمجموعه‌های آن که در راستای سیاست‌های دولت جهت بازسازی سریع کشور و جبران خسارت‌های جنگ برای تامین کالاها و خدمات مورد نیاز جامعه، مورد توجه قرار گرفته بود، از بیشترین رشد در ارزش افزوده برخوردار شد. با این حال، رشد این بخش در مقایسه با سایر بخش‌های اقتصادی نظیر کشاورزی، نفت و خدمات به شدت پرنوسان و بی‌ثبات بود. به گونه‌ای که رشد متوسط بخش صنایع و معادن از ۲۶/۴ درصد در سال ۱۳۶۹ به ۰/۱- درصد در سال پایان برنامه رسید. گرچه نوسان و روند نزولی رشد ارزش افزوده در زیربخش‌های ساختمان، معدن و برق، آب و گاز نیز وجود داشته، لیکن نوسان و کاهش شدید رشد زیربخش صنعت عامل اصلی کاهش و بی‌ثباتی رشد گروه صنایع و معادن در این دوره بوده است.

چنانکه ذکر شد، نوسانات نرخ ارز، سررسید بدهی‌های کوتاه‌مدت و بحران بوجود آمده ناشی از آن و نهایتاً شناورسازی نرخ ارز در سال‌های پایانی برنامه اول از عوامل مهم بی‌ثباتی رشد در همه بخش‌ها به شمار می‌آید. لیکن در میان این بخش‌ها، گروه صنایع و معادن به دلیل وابستگی زیاد به واردات مواد اولیه، تجهیزات و ماشین‌آلات، تأثیرپذیری بیشتری از این بحران داشته و با کاهش زیاد در رشد ارزش افزوده مواجه شد. تداوم این روند و بحران ارزی که به تغییر رویکرد و چرخش سیاست اقتصادی (از سیاست تعدیل به تثبیت اقتصادی) منجر گردید، همچنین، بروز بحران ارزی ناشی از کاهش درآمدهای ارزی کشور که به واسطه کاهش شدید قیمت جهانی نفت در سال ۱۳۷۷ به وقوع پیوست، موجب شد تا در برنامه دوم توسعه، رشد متوسط گروه صنایع و معادن به کمترین مقدار خود برسد و نوسان و بی‌ثباتی رشد آن نیز افزایش یابد.

در برنامه سوم توسعه با اتخاذ سیاست‌های مناسب در سایر بخش‌های کلان اقتصادی (مالی، پولی و خارجی) و همچنین برقراری شرایط نسبتاً باثبات و پایدار در بخش واقعی اقتصاد، بخش صنایع و معادن و زیربخش‌های آن نیز همگام با سایر بخش‌های اقتصاد از رشد فزاینده توأم با ثبات بیشتر برخوردار گردید. این روند در سال‌های برنامه چهارم (۲ سال اول برنامه) نیز تداوم یافت. در این میان، اعطای تسهیلات ارزی از محل

حساب ذخیره ارزی (OSF)^۱ جهت تکمیل طرح‌های نیمه‌تمام و پروژه‌های صنعتی که از ابتدای برنامه سوم آغاز گردیده بود، نقش زیادی در بهبود عملکرد و رشد بخش صنایع و معادن ایفا نمود.

ارزش افزوده بخش نفت در سال‌های برنامه اول توسعه از رشد بالایی برخوردار بود و پس از گروه صنایع و معادن بیشترین میزان میانگین رشد را داشت. علی‌رغم اینکه در سال‌های پایانی برنامه از رشد آن کاسته شد، لیکن به واسطه رشد مناسب تولید، رشد متوسط ارزش افزوده این بخش در برنامه اول در مقایسه با سایر برنامه‌ها بسیار بالا بود. علاوه بر این، نسبت به برنامه‌های مزبور ضریب پراکندگی کمتری نیز داشت. استفاده از ظرفیت‌های خالی موجود که به دلیل جنگ تحمیلی راکد مانده بود و افزایش ظرفیت تولید ناشی از سرمایه‌گذاری‌های جدید عامل اصلی رشد بخش نفت در این دوره بود.

شایان ذکر است که در چارچوب سیاست‌های دولت و براساس تبصره‌های قوانین سنواتی بودجه کل کشور در سال‌های برنامه اول، مقرر گردید تا منابع مالی مورد نیاز این بخش از محل منابع داخلی (سود ویژه شرکت‌ها) و همچنین، درآمدهای مندرج در تبصره‌های بودجه تأمین شود. این امر سبب رشد تشکیل سرمایه ثابت بخش نفت به ویژه در سال‌های ابتدای برنامه گردید.

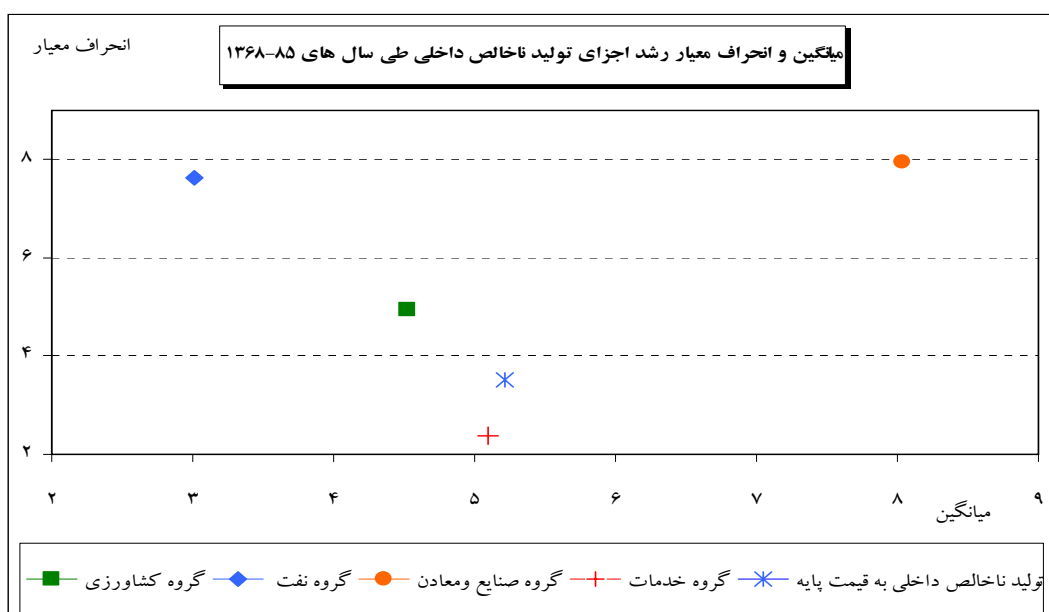
در برنامه دوم توسعه، میانگین رشد بخش نفت به دلیل کاهش رشد تولید، بحران کاهش قیمت جهانی نفت و کاهش سهمیه تولید ایران در اوپک به کمترین میزان خود رسید و منفی گردید، در حالی که بیشترین ضریب پراکندگی و نوسان را در میان سایر برنامه‌ها داشت. در برنامه سوم توسعه، گرچه میانگین رشد بخش نفت بهبود یافت، لیکن مقدار آن بسیار کمتر از میانگین سال‌های برنامه اول بود. رشد مزبور در برنامه چهارم مجدداً کاهش یافت، لیکن میزان ضریب پراکندگی آن در مقایسه با برنامه‌های قبل روند کاهشی داشت و در برنامه‌های سوم و چهارم نوسان و بی‌ثباتی کمتری داشت.

بخش کشاورزی ایران در مقایسه با سایر بخش‌های تولیدی (صنایع و معادن و نفت) وابستگی کمتری به درآمدهای ارزی کشور داشته و فعالیت‌های آن عمدتاً درون‌زا می‌باشد. با توجه به این امر و به دلیل استفاده از ظرفیت‌های خالی و همچنین، تصویب قانون خرید تضمینی محصولات کشاورزی در سال ۱۳۶۸ این بخش در برنامه اول از میانگین رشد مناسب و نسبتاً کم‌نوسان برخوردار بود. اما با بروز خشکسالی و کم‌آبی در برخی سال‌های برنامه دوم از رشد آن کاسته شد. با بهبود شرایط اقلیمی در برنامه سوم توسعه، میانگین رشد این بخش افزایش یافته و در

۱- Oil Stabilization Fund (OSF)

۲ سال اول برنامه چهارم نیز تداوم داشته است. علاوه بر این، در سال‌های برنامه سوم و چهارم از میزان نوسان و ضریب پراکندگی رشد بخش کشاورزی کاسته شده و رشد آن نسبتاً با ثبات گردیده است.

در میان زیربخش‌های تولید ناخالص داخلی، میانگین رشد بخش خدمات بسیار کم‌نوسان و باثبات بوده است. رشد این بخش در تمام سال‌های مورد مطالعه مثبت بوده و گرچه میزان ضریب پراکندگی آن در برنامه اول تا حدودی بالا بود، لیکن از برنامه دوم توسعه از نوسان رشد آن کاسته شده است. به گونه‌ای که در طول دوره مورد بررسی، بخش خدمات که حدود نیمی از ارزش افزوده کل را به خود اختصاص داده از کمترین میزان نوسان رشد برخوردار بوده و ثبات بسیار زیادی داشته است. اما بخش نفت، کمترین میانگین رشد و بیشترین نوسان و بی‌ثباتی را دارا بوده است.

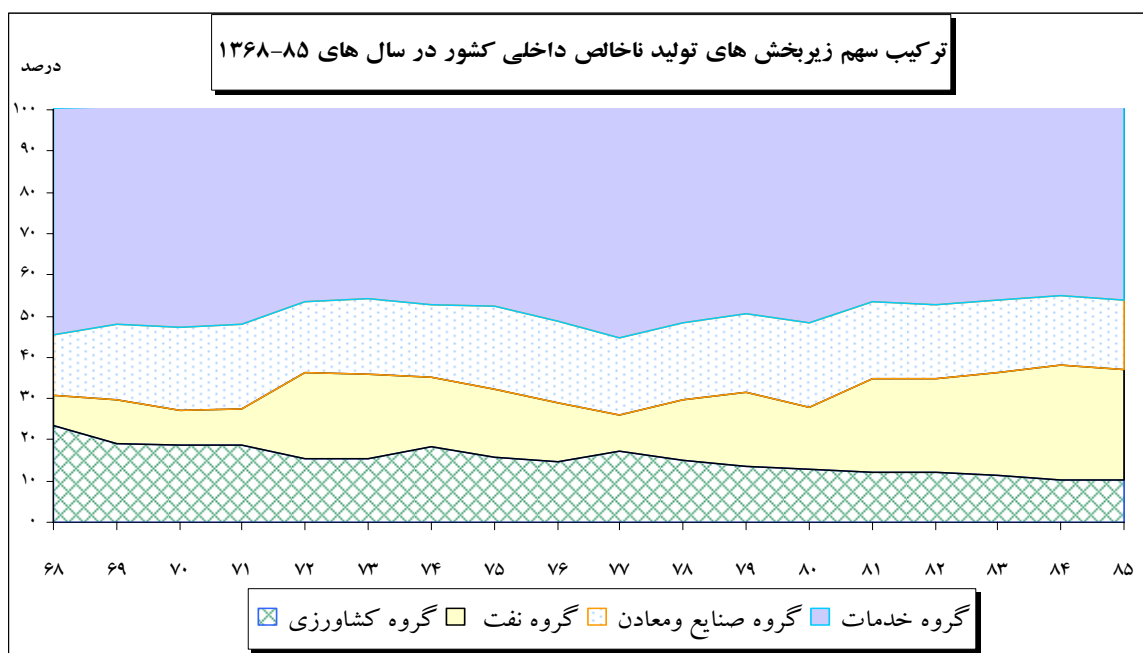


بررسی سهم زیربخش‌های مختلف نشان می‌دهد که در طول برنامه‌های توسعه از سهم بخش‌های کشاورزی، خدمات و صنایع و معادن کاسته شده و سهم بخش نفت $2/5$ برابر افزایش یافته است. تغییر رژیم ارزی (تک نرخی نمودن ارز) در برنامه سوم توسعه و افزایش قیمت نفت و فرآورده‌های آن در بازارهای جهانی که از ابتدای برنامه چهارم آغاز گردید از دلایل اصلی افزایش چشمگیر سهم بخش نفت می‌باشد.

در میان بخش‌های تولیدی کشور با توجه به حمایت‌های ارزی و ریالی صورت گرفته از صنایع و معادن (از محل تسهیلات بانکی و حساب ذخیره ارزی OSF) و افزایش میزان تولید، کاهش سهم این بخش طی دوره مورد بررسی در مقایسه با کاهش سهم کشاورزی و خدمات بوده است. لیکن، سهم بخش کشاورزی به دلیل عدم افزایش مناسب تولید و قیمت محصولات آن، همواره روند نزولی داشته است. مشکلاتی نظیر یکپارچه نشدن اراضی، فقدان سیستم‌های آبیاری پیشرفته، عدم حمایت‌های اصولی و کاهش سهم تشکیل سرمایه آن از تشکیل سرمایه کل از عوامل اصلی عدم افزایش قابل توجه تولید در بخش کشاورزی بوده است. بروز پدیده خشکسالی و کم‌آبی در برخی سال‌ها نیز این روند را تشدید نموده و موجب کاهش شدید سهم آن در سال‌های اخیر شده است.

نسبت ارزش افزوده اجزای تولید ناخالص داخلی به GDP درصد

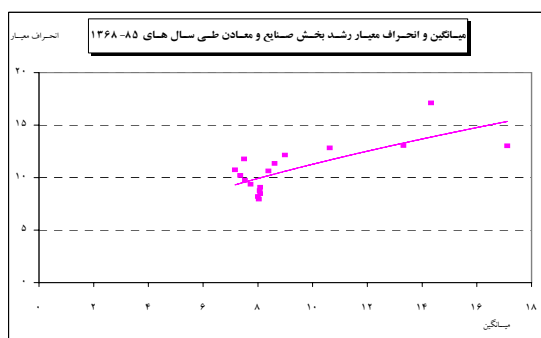
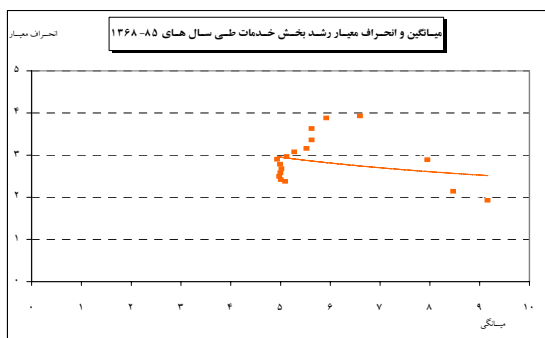
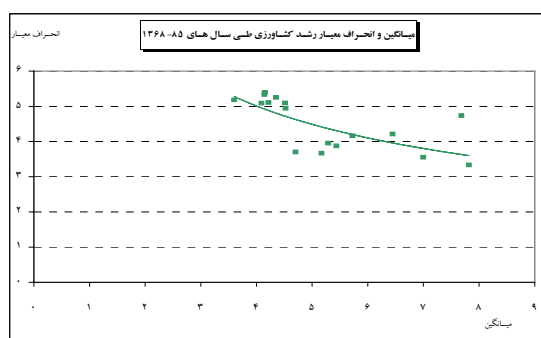
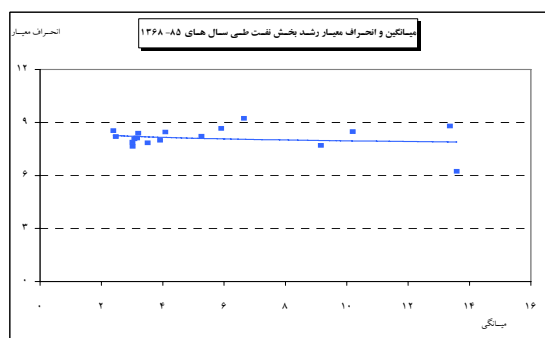
عنوان	کل دوره	متوسط برنامه			
		برنامه اول	برنامه دوم	برنامه سوم	برنامه چهارم
گروه کشاورزی	۱۵،۲	۱۹،۰	۱۶،۲	۱۲،۴	۱۰،۳
گروه نفت	۱۷،۰	۱۱،۳	۱۴،۱	۲۰،۷	۲۷،۲
گروه صنایع و معادن	۱۸،۴	۱۸،۱	۱۹،۱	۱۸،۷	۱۷،۰
گروه خدمات	۵۰،۷	۵۲،۴	۵۱،۷	۴۹،۹	۴۸،۱
کسر میشود: کارمزداحتسابی	۱،۳	۰،۷	۱،۱	۱،۷	۲،۶
تولید ناخالص داخلی به قیمت پایه	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰



علاوه بر بررسی وضعیت میانگین و انحراف معیار رشد اجزای تولید ناخالص داخلی، میانگین و انحراف معیار تجمعی آنها نیز مورد مقایسه قرار گرفته است. بررسی میانگین و انحراف معیار تجمعی رشد بخش کشاورزی حاکی از آن است که مشاهدات مربوطه از الگوی مشخص برخوردار بوده است. به طوری که با کاهش میانگین رشد، انحراف معیار آن نیز کاهش یافته است.

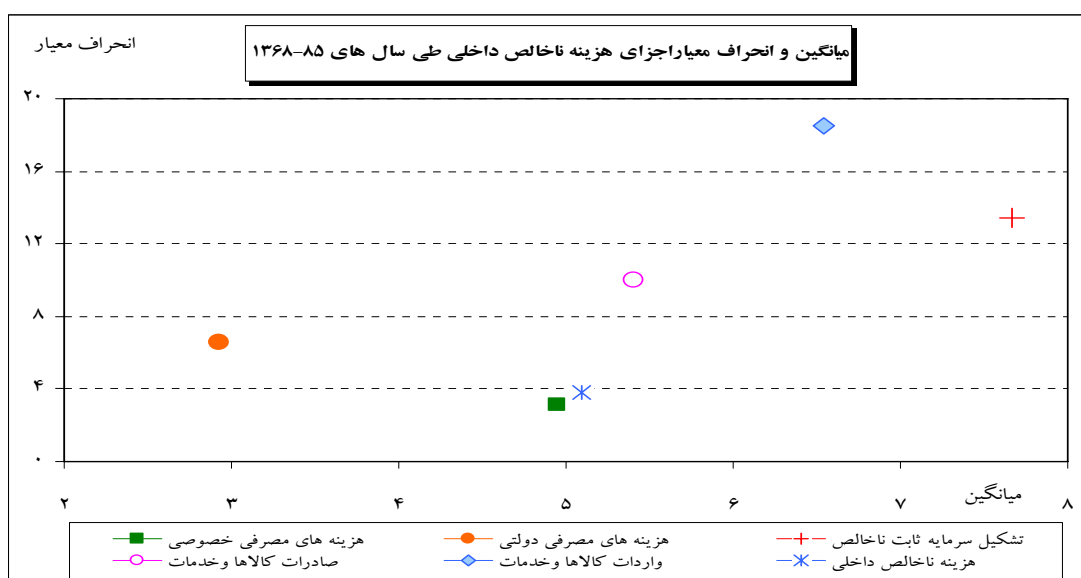
در خصوص رشد بخش نفت، علی‌رغم نوسان زیاد میانگین رشد، انحراف معیار آن حول دامنه مشخصی قرار داشته است. این امر بیانگر آن است که افزایش میانگین رشد بخش نفت با افزایش بی‌ثباتی در رشد این بخش همراه نبوده است.

در بخش‌های صنایع و معادن و خدمات نیز (بجز تعداد محدودی از مشاهدات) وضعیت کلی انحراف معیار و میانگین رشد نشان می‌دهد که مقدار میانگین در دامنه محدودی قرار داشته و دامنه نوسان و انحراف معیار بیشتر بوده است.



۲-۳- رشد اجزای هزینه ناخالص داخلی

طی سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ مصرف خصوصی از رشد متوسط ۴/۹ درصد برخوردار بوده و کمترین نوسان و بی‌ثباتی را داشته است. اما هزینه‌های مصرفی دولت، علی‌رغم رشد پایین، بیشترین نوسان و بی‌ثباتی را داشته است. در برنامه دوم توسعه به دلیل بی‌ثباتی‌های اقتصادی ناشی از بحران ارزی، تورم و جهش قیمت‌های دارایی‌ها، هزینه‌های مصرفی جامعه از کمترین رشد برخوردار بوده است. با بهبود شرایط و ثبات نسبی اقتصاد در برنامه سوم، رشد مصرف نیز افزایش یافته و به تدریج از نوسان آن کاسته شده است. این روند در سال‌های بعد نیز تداوم داشته است.



در میان اجزای هزینه ناخالص داخلی، تشکیل سرمایه ثابت بیشترین میانگین رشد را داشته است. اما رشد مزبور از ثبات کمتری برخوردار بوده که در سال‌های برنامه اول به دلیل عدم ثبات سیاست‌های اقتصادی اتخاذ شده بوده است. در ۲ سال ابتدای برنامه چهارم، مسائل سیاسی و مشکل تحریم‌های اقتصادی ناشی از انرژی هسته‌ای نیز بر آن افزوده شده و موجب کاهش رشد سرمایه‌گذاری به ویژه در بخش ماشین‌آلات گردیده است.

طی دوره مورد بررسی، رشد اجزای واردات و صادرات از نوسان زیادی برخوردار بوده و سهم صادرات غیر نفتی از تولید ناخالص از ۶ درصد فراتر نرفته است. ضمن اینکه نسبت مزبور در طول برنامه‌های توسعه روند کاهنده داشته که بیانگر عدم موفقیت سیاست‌های اتخاذ شده جهت تشویق و توسعه صادرات می‌باشد.

مشخصه های آماری رشد اجزای هزینه ناخالص داخلی در برنامه های توسعه (۱)

ضریب پراکندگی					میانگین برنامه					عنوان
چهارم	سوم	دوم	اول	کل	چهارم	سوم	دوم	اول	کل	
۰،۰۵	۰،۳۹	۰،۹۹	۰،۶۳	۰،۶۴	۶،۴	۷،۴	۳،۱	۴،۴	۴،۹	هزینه های مصرفی خصوصی
۰،۳۱	۱،۲۸	-۱،۷۷	۱،۹۶	۲،۳۹	۹،۵	۳،۷	-۲،۲	۴،۶	۲،۷	هزینه های مصرفی دولتی
۰،۲۹	۰،۴۲	۱،۴۰	۲،۴۰	۰،۷۲	۴،۲	۹،۵	۸،۰	۹،۲	۴،۵	کل هزینه های مصرفی
۰،۲۹	۰،۴۲	۱،۴۰	۲،۴۰	۱،۹۴	۴،۲	۹،۵	۸،۰	۹،۲	۶،۹	تشکیل سرمایه ثابت ناخالص
۰،۳۹	۰،۵۱	۱،۲۶	۴،۳۴	۲،۴۳	۴،۱	۱۲،۲	۱۵،۴	۸،۵	۹،۱	ماشین آلات
۰،۱۴	۱،۲۴	۶،۰۲	۱،۰۹	۲،۰۱	۴،۳	۵،۶	۱،۴	۹،۷	۴،۵	ساختمان
۰،۰۳	۰،۳۱	۱،۵۳	۲۶،۳۳	۳،۱۴	۴،۱	۱۲،۳	۱۳،۷	۱،۴	۶،۸	بخش خصوصی
۱،۰۲	۱،۸۸	۹،۲۶	۱،۰۵	۲،۴۰	۴،۴	۴،۱	۱،۲	۲۲،۷	۷،۲	بخش دولتی
۰،۲۰	۱،۶۸	-۴،۳۳	۰،۶۵	۲،۰۳	۶،۰	۳،۶	-۲،۷	۱۳،۹	۴،۹	صادرات کالاها و خدمات
NA	۲،۹۷	-۲،۷۹	۰،۶۴	۲،۵۲	NA	۳،۰	-۳،۹	۱۴،۰	۴،۵	کالاها
۰،۷۲	۴،۷۲	-۳،۸۴	۰،۹۲	۳،۱۷	۳۴،۷	۲،۲	-۱،۰	۹،۲	۲،۸	نفت و گاز
NA	۲،۴۱	-۲،۹۳	۰،۵۲	۲،۳۷	NA	۴،۷	-۹،۱	۳۴،۷	۱۱،۱	سایر
NA	۲،۳۹	۱،۴۷	۵،۸۶	۲،۱۴	NA	۱۲،۳	۴۴،۹	۸،۰	۲۲،۸	خدمات
۰،۷۹	۰،۴۲	۱۶،۴۵	۲،۶۷	۳،۸۳	۴،۶	۱۷،۲	۰،۶	۹،۱	۴،۸	واردات کالاها و خدمات
NA	۰،۴۷	-۱۸،۶۵	۲،۸۴	۴،۸۹	NA	۱۴،۱	-۰،۵	۸،۴	۴،۰	کالاها
NA	۱،۷۲	۱،۶۱	۲،۰۷	۴،۵۲	NA	۱۴،۳	۸،۹	۱۴،۴	۶،۳	خدمات
۰،۱۶	۰،۳۱	۰،۵۸	۰،۹۱	۰،۷۶	۵،۳	۵،۷	۳،۵	۶،۹	۵،۰	هزینه ناخالص داخلی

× ارقام تشکیل سرمایه در بخش های دولتی و خصوصی در سال های ۸۵-۱۳۸۳ برآوردی است و دوره قسمت زرد رنگ ۸۲-۱۳۶۸ می باشد.

بررسی ترکیب هزینه ناخالص داخلی نشان می‌دهد که مجموع مصرف خصوصی و دولتی بالاترین سهم را از کل هزینه ناخالص داخلی دارا می‌باشد. به گونه‌ای که طی دوره مورد بررسی، سهم هزینه‌های مصرفی به طور متوسط بیش از ۶۰ درصد هزینه‌های کل بوده است.

به دلیل تغییر الگوی مصرف و جبران محدودیت‌های مصرفی دوران جنگ تحمیلی که به افزایش تقاضای جامعه منجر گردید، سهم مصرف بخش خصوصی از هزینه ناخالص طی برنامه اول در بیشترین مقدار خود قرار داشت. اما با تامین نسبی بخشی از نیازهای مصرفی به تأخیر افتاده به تدریج از سهم هزینه‌های مصرفی کاسته شد.

با کاهش سهم مصرف بخش خصوصی در طول برنامه‌های توسعه از سهم هزینه‌های مصرفی کل نیز کاسته شد، لیکن سهم هزینه‌های مصرفی بخش دولتی کماکان بالا مانده است. با توجه به سیاست‌های اتخاذ شده در سال‌های برنامه جهت کاهش اندازه دولت، کاهش نیافتن سهم هزینه‌های مصرفی دولت، بیانگر عدم موفقیت در واگذاری فعالیت‌ها به بخش غیر دولتی (خصوصی‌سازی) و کاهش هزینه‌های مربوطه بوده است.

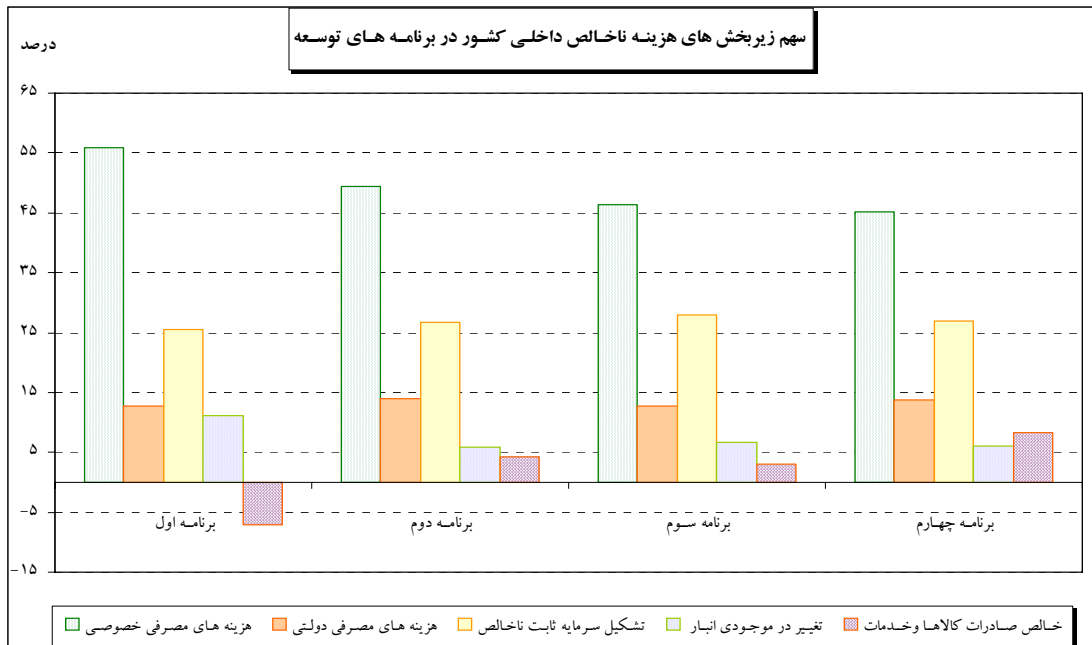
شایان ذکر است که تغییر الگوی مصرف، ترکیب و ساختار جمعیت، انتظارات تورمی جامعه، بازده دارایی‌های فیزیکی، نرخ بازده پس‌انداز، رشد درآمد سرانه و نظایر آن از جمله عوامل مؤثر در کاهش روند مصرف به شمار می‌آیند.

درصد

نسبت اجزای هزینه ناخالص داخلی به GDP

عنوان	کل دوره	متوسط برنامه		
		اول	دوم	چهارم
هزینه های مصرفی خصوصی	۴۹.۷	۵۵.۸	۴۹.۵	۴۵.۲
هزینه های مصرفی دولتی	۱۳.۴	۱۲.۷	۱۴.۱	۱۳.۷
کل هزینه های مصرفی	۶۳.۱	۶۸.۵	۶۳.۶	۵۸.۹
تشکیل سرمایه ثابت ناخالص	۲۶.۵	۲۵.۶	۲۶.۷	۲۶.۹
ماشین آلات	۱۳.۸	۱۱.۴	۱۴.۰	۱۵.۸
ساختمان	۱۲.۷	۱۴.۲	۱۲.۷	۱۱.۱
بخش خصوصی	۱۶.۷	۱۷.۱	۱۶.۲	۱۷.۲
بخش دولتی	۹.۷	۸.۵	۱۰.۵	۹.۶
تغییر در موجودی انبار	۷.۳	۱۱.۲	۶.۰	۶.۰
خالص صادرات کالاها و خدمات	۲.۰	-۷.۰	۴.۲	۸.۳
صادرات کالاها و خدمات	۲۲.۲	۱۶.۳	۱۹.۰	۳۳.۰
صادرات نفت و گاز	۱۳.۶	۱۰.۳	۱۲.۹	NA
صادرات کالاهای غیرنفتی	۵.۸	۵.۸	۵.۳	NA
صادرات خدمات	۰.۹	۰.۲	۰.۸	NA
واردات کالاها و خدمات	۲۰.۲	۲۳.۳	۱۴.۸	۲۴.۷
واردات کالا	۱۶.۸	۲۰.۴	۱۳.۰	NA
خدمات	۲.۴	۲.۹	۱.۷	NA
اشتباهات آماری	۱.۱	۱.۷	-۰.۵	NA
هزینه ناخالص داخلی	۱۰۰.۰	۱۰۰.۰	۱۰۰.۰	۱۰۰.۰

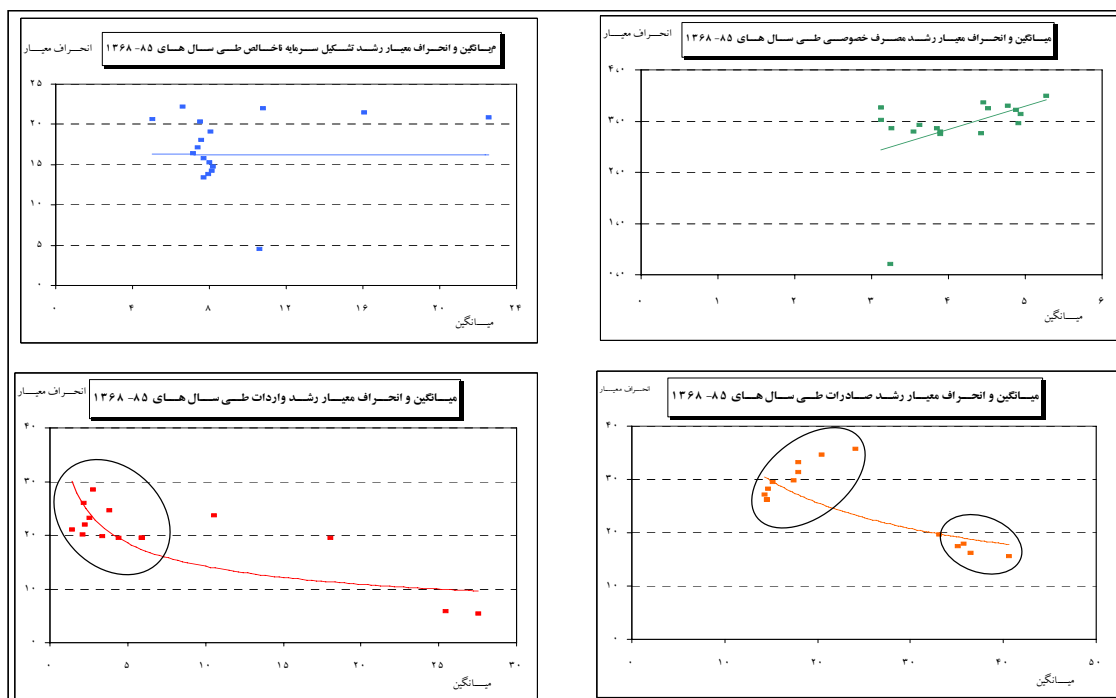
ارقام تشکیل سرمایه در سال های ۸۵-۱۳۸۳ برآوردی است و دوره قسمت های زرد رنگ ۸۲-۱۳۶۸ می باشد.



بررسی میانگین و انحراف معیار تجمعی رشد مصرف خصوصی در دوره مورد بررسی نشان می‌دهد علی‌رغم اینکه رشد متوسط مصرف افزایش یافته، اما انحراف معیار آن در دامنه محدودی نوسان داشته و از مقدار نسبتاً ثابتی برخوردار بوده است. این امر به مفهوم ثبات و اینرسی عادات مصرفی جامعه می‌باشد.

نتایج حاصله در خصوص رشد تشکیل سرمایه ثابت ناخالص نیز حاکی از آن است که عملکرد رشد تشکیل سرمایه در ایران در سطوح نسبتاً پایین قرار داشته و با بی‌ثباتی زیادی مواجه بوده است. بی‌ثباتی تشکیل سرمایه و سرمایه‌گذاری نماگر مهمی برای بی‌ثباتی عملکرد رشد اقتصادی محسوب می‌شود.

روند کلی انحراف معیار و رشد واردات نیز به صورت نزولی بوده و نشان می‌دهد که با کاهش میانگین بر نوسان و انحراف معیار آن افزوده می‌شود. در خصوص صادرات گرچه خط روند نزولی است، اما دو مجموعه از مشاهدات مورد بررسی، نتایج متفاوتی را نشان می‌دهند.



۴- اجزای ساختاری (رشد) تولید و هزینه ناخالص

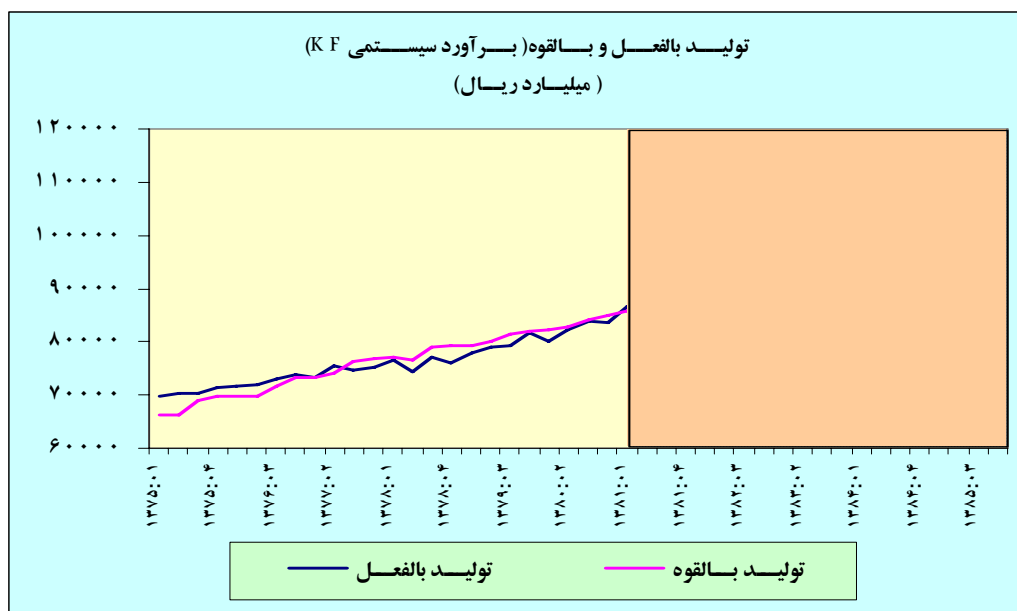
بررسی اجزای ساختاری رشد اقتصادی، بیانگر رشد صعودی روند بلندمدت تولید و هزینه ناخالص داخلی به قیمت‌های ثابت ۱۳۷۶ (تولید بالقوه) طی دوره مورد بررسی است. به دلیل رشد تشکیل سرمایه ثابت ناخالص (سرمایه‌گذاری)، استفاده از ظرفیت‌های خالی و سایر عوامل موثر بر عرضه کل، این روند طی برنامه اول توسعه در مقایسه با سایر مقاطع شیب بیشتری داشته است. اما به دلیل چرخش سیاستی و مشکلات اقتصادی به وجود آمده که قبلاً نیز ذکر شد در پایان برنامه اول و سال‌های ابتدای برنامه دوم از سرعت رشد تولید تا حدودی کاسته شده است.

در سال‌های برنامه سوم با اتخاذ سیاست‌های نسبتاً مناسب اقتصادی و افزایش رشد تشکیل سرمایه به ویژه در بخش صنایع و معادن بر سرعت روند رشد تولید افزوده شد که این وضعیت در سال‌های ابتدای برنامه چهارم نیز تداوم یافته است.

مقایسه تولید بالفعل و تولید بالقوه نشان می‌دهد که در سال‌های برنامه اول و همچنین از سال ۱۳۸۱ با ایجاد فشارهای تقاضای ناشی از انبساط پولی، رشد شدید قیمت‌های جهانی نفت و سایر عوامل مؤثر تولید حقیقی از مسیر تعادلی و بلندمدت خود فزونی گرفته و شکاف تولید مثبت بوده است. به عبارت دیگر انحراف تولید واقعی از روند بالقوه آن در این مقطع به وجود آمده است.

افزایش روند شکاف تولید ناشی از فشار تقاضا حاکی از آن است که از ظرفیت موجود اقتصاد کشور به میزان بالاتر از حد بهینه استفاده می‌شود. در این وضعیت، سیاست‌های اقتصادی کشور می‌بایستی بر افزایش تولید بالقوه، بهبود فضای کسب و کار و انجام سرمایه‌گذاری مولد متمرکز گردد. علاوه بر این، تکمیل طرح‌ها و پروژه‌های عمرانی نیمه‌تمام دولتی به گونه‌ای که موجب فشارهای تورمی نگردند از اولویت برخوردار بوده و مناسب‌ترین گزینه پیش‌رو می‌باشد.

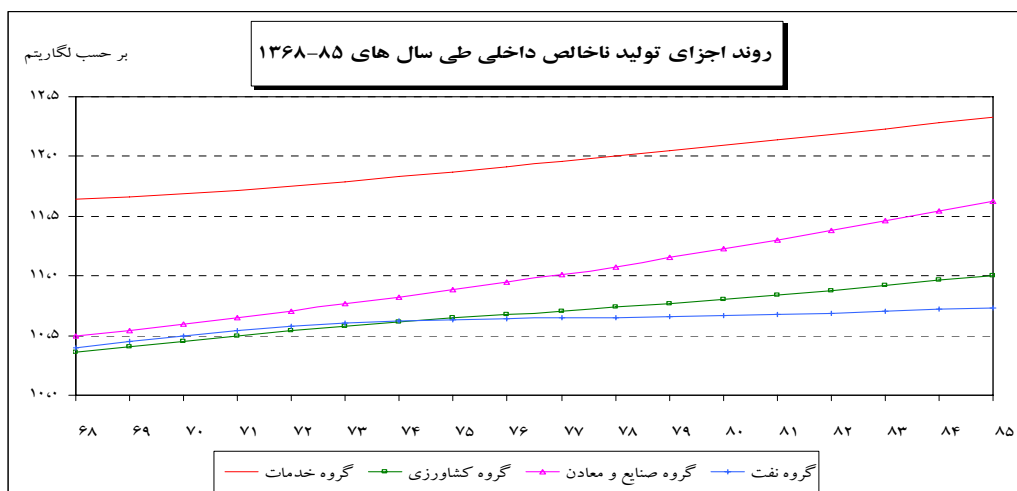
مقایسه روند بلندمدت و عملکرد جاری تولید



۴-۱- اجزای ساختاری روند زیربخش‌های اقتصادی

در سال‌های مورد بررسی، روند بلندمدت بخش‌های خدمات، صنایع و معادن و کشاورزی مشابه روند تولید ناخالص بوده است. به گونه‌ای که در ابتدا رشد صعودی داشته، در برنامه دوم از رشد آن کاسته شده و در سال‌های برنامه سوم و دو سال اول برنامه چهارم، مجدداً رشد فزاینده یافته است.

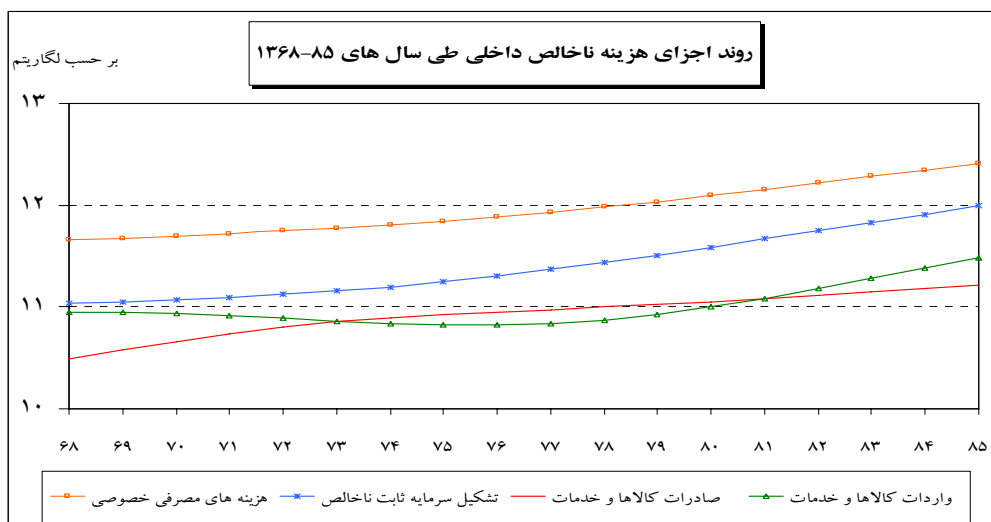
علی‌رغم این در بخش خدمات، دوره کاهش روند بلندمدت کوتاه‌تر بوده و روند رشد آن تداوم یافته است. همچنین در بخش نفت، روند تولید بالقوه تا حدودی متفاوت از سایر بخش‌ها بوده است. به دلیل افزایش سرمایه‌گذاری‌های انجام شده در پروژه‌های جدید و استفاده از ظرفیت‌های راکد، مناطق نفت‌خیزی که در مقطع جنگ تحمیلی امکان بهره‌برداری از آنها فراهم نبود در برنامه اول رشد فزاینده‌ای داشت. در سال‌های بعد، رشد تولید بخش نفت صرفاً به سرمایه‌گذاری‌های جدید منوط گردیده و به دلیل محدودیت‌های سهمیه‌ای اوپک، روند رشد بلندمدت آن محدود گردید. کاهش قیمت جهانی در سال‌های پایان برنامه دوم و محدودیت سهمیه‌ای بیشتر بر تداوم کاهش روند رشد افزوده است. لیکن با افزایش قیمت جهانی، تعدیل سهمیه‌ها و بهره‌برداری از پروژه‌های جدید، روند افزایشی تولید بالقوه بخش نفت با شیب ثابت آغاز شده و تاکنون نیز ادامه یافته است.



در بخش کشاورزی نیز به دلیل افزایش سطح زیرکشت محصولات به خصوص در مناطقی که به واسطه نزدیکی به مناطق جنگی قبلاً امکان کشت و زرع در آن فراهم نبود و همچنین، افزایش سرمایه‌گذاری‌ها، روند بلندمدت تولید در ابتدای برنامه اول از شتاب بیشتری برخوردار شد. علی‌رغم این به دلیل مشکلات ساختاری بخش کشاورزی و کاهش بارندگی و خشکسالی در سال‌های پایانی برنامه دوم، فرایند رشد کاهنده تداوم یافته است. در سال‌های برنامه سوم و ابتدای برنامه چهارم روند مزبور بهبود یافته و رو به رشد بوده است.

به دلیل اهمیت بخش صنایع و معادن در سیاست‌های اتخاذ شده جهت بازسازی اقتصادی کشور و حمایت‌های ارزی و ریالی صورت گرفته از این بخش به ویژه استفاده از منابع ذخیره ارزی جهت تکمیل طرح‌ها و پروژه‌های نیمه‌تمام، روند رشد بلندمدت بخش صنایع و معادن رشد صعودی داشته و در میان سایر بخش‌های تولیدی کشور از روند مناسب و پایداری برخوردار بوده است.

در میان اجزای هزینه ناخالص، روند بلندمدت هزینه‌های مصرفی خصوصی و تشکیل سرمایه ثابت ناخالص با روند هزینه ناخالص همسانی داشته، لیکن روند بلندمدت واردات و صادرات بسیار پرنوسان و متفاوت بوده است. در این میان، روند رشد مصرف بخش خصوصی در برنامه دوم تا حدودی تعدیل شده و پس از کاهش شتاب آن در سال‌های برنامه سوم، مجدداً به روند صعودی خود با روندی نسبتاً ثابت ادامه داده است. درحالی که روند هزینه‌های دولتی در ابتدای برنامه اول صعودی با شیب بسیار ملایم بوده و سبب شده تا هزینه‌های مصرفی کل با تاخیر بیشتری نسبت به هزینه ناخالص دارای رشد صعودی با شیب تند شود.



با پایان یافتن جنگ تحمیلی و عزم جدی دولت جهت بازسازی خرابی‌های ناشی از آن و اتخاذ سیاست حمایت از سرمایه‌گذاری و تولید، روند بلندمدت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص که از عوامل اصلی و موثر بر تولید و درآمد ملی به شمار می‌آید در سال‌های ابتدای برنامه اول رو به رشد بوده است. به دلیل بی‌ثباتی بوجود آمده در اقتصاد و افزایش ریسک سرمایه‌گذاری که از نوسانات نرخ ارز، افزایش انتظارات تورمی و نظایر آن ناشی گردید، طی برنامه دوم رشد کاهنده یافت.

با اتخاذ سیاست‌های مناسب پولی و ارزی که به کاهش تورم و کنترل نرخ ارز منجر شد و ایجاد حساب ذخیره ارزی که جهت کاهش اثرات منفی تقلیل درآمدهای نفتی بر فرایند رشد اقتصادی بوجود آمد و همچنین با افزایش ثبات سیاسی در کشور، سرمایه‌گذاری در برنامه سوم رشد فزاینده یافت. لیکن در سال‌های اخیر، عمدتاً به دلیل ریسک‌های سرمایه‌گذاری ناشی از مسائل سیاسی و تحریم‌های اقتصادی از روند رشد بلندمدت سرمایه‌گذاری کاسته شده است.

روند بلندمدت متغیرهای واردات و صادرات تا حدودی متفاوت از روند هزینه ناخالص بوده و تغییر روند آن به ویژه در بخش واردات زیاد بوده است. در ابتدای برنامه اول، روند واردات در جهت تامین مواد اولیه و واسطه‌ای صنایع کشور و تقاضای کل از رشد با شیب نسبتاً ثابت برخوردار بوده است. با بروز بحران بدهی‌های ارزی، محدودیت منابع و اتخاذ سیاست تثبیت نرخ ارز، روند آن کاهنده شد و تا پایان برنامه دوم و زمان کاهش درآمدهای نفتی در سال ۱۳۷۷ تداوم یافته است.

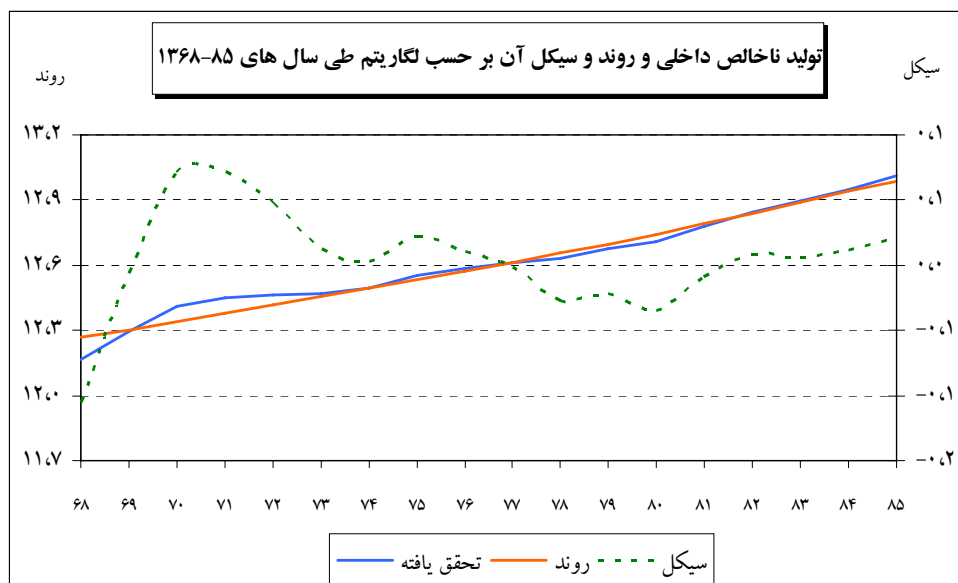
با افزایش فشار بر سمت عرضه جهت تامین فزونی تقاضا در سال‌های برنامه سوم و چهارم، روند بلندمدت واردات صعودی شده و رشد آن تداوم یافته است. اما عمدتاً در راستای واردات مواد اولیه و واسطه‌ای بوده و کالاهای سرمایه‌ای افزایش مناسبی نداشته است. برخلاف واردات، روند رشد صادرات در برنامه اول صعودی شتابان بوده و به تدریج رشد کاهنده و سپس رشد ثابت داشته است.

۵- اجزای ساختاری (سیکل) تولید و هزینه ناخالص

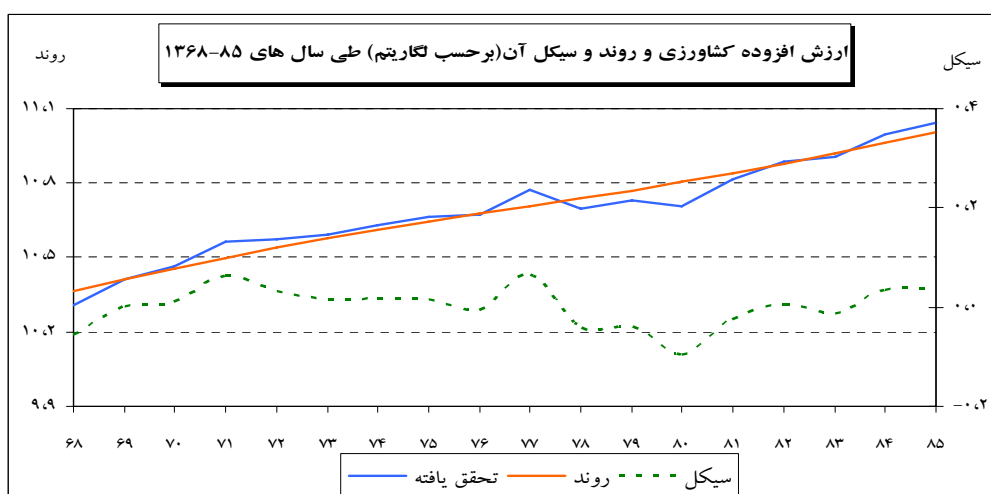
سیکل تولید و هزینه ناخالص داخلی و اغلب اجزای آن در برنامه‌های اول تا چهارم توسعه دارای نوسان زیادی بوده است. در برنامه اول، سال‌های ابتدای برنامه دوم و سال‌های پس از ۱۳۸۱ به دلیل فشار تقاضای ایجاد شده در اقتصاد، عملکرد تولید ناخالص از میزان بالقوه آن فراتر رفته و سیکل‌های مثبت بوجود آمده است.

در سال‌های پایانی برنامه دوم به دلیل کاهش فزونی تقاضا، سیکل‌های تولید منفی گردیده و شرایط نسبتاً رکودی ایجاد شده است. اما، طول دوره سیکل منفی سال‌های پایانی برنامه دوم و ابتدای برنامه سوم در مقایسه با سیکل مثبت سال‌های قبل کوتاه‌تر بوده و از میزان نوسان آن نیز به میزان قابل توجهی کاسته شده است. همچنین در سال‌های پس از ۱۳۸۱ هم که مجدداً سیکل مثبت شروع شده و روند رونق شکل گرفته است، سیکل‌ها دارای نوسان کمتری در مقایسه با دوره اول است که غالباً ناشی از تفاوت اندک تولید واقعی از تولید بالقوه می‌باشد.

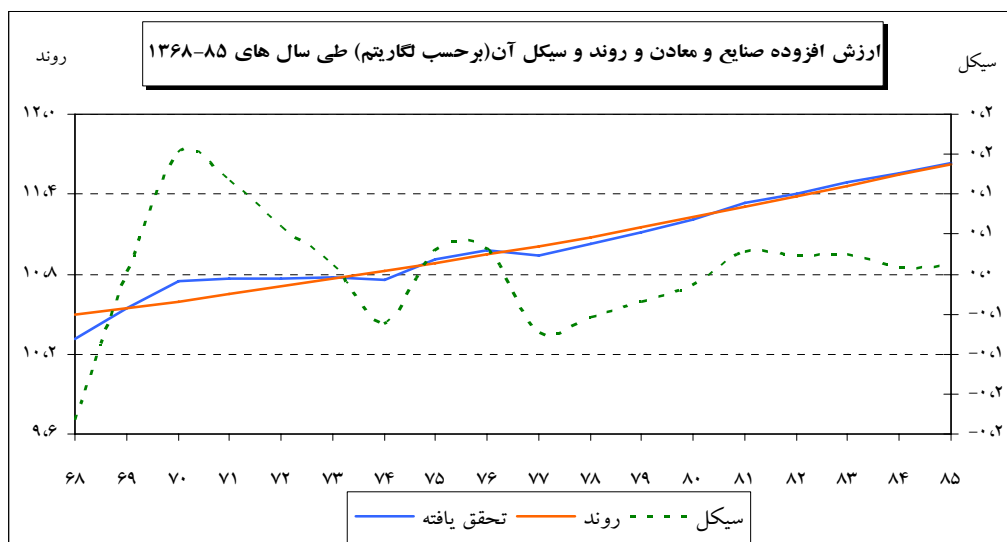
چرخش سیاستی از تعدیل به تثبیت اقتصادی در کاهش میزان رونق و سیکل مثبت ابتدای برنامه دوم موثر بوده و کاهش درآمدهای نفتی ناشی از افت قیمت جهانی نفت و کاهش تقاضا موجب ایجاد سیکل منفی گردید. لیکن، اتخاذ سیاست‌های نسبتاً هماهنگ پولی، مالی و ارزی در برنامه سوم و ثبات نسبی سیاسی به ویژه در بخش خارجی که بر فعالیت عاملان اقتصادی و میزان تقاضا تاثیر گذاشت در ایجاد سیکل مثبت و افزایش میزان تولید از روند بالقوه موثر بود.



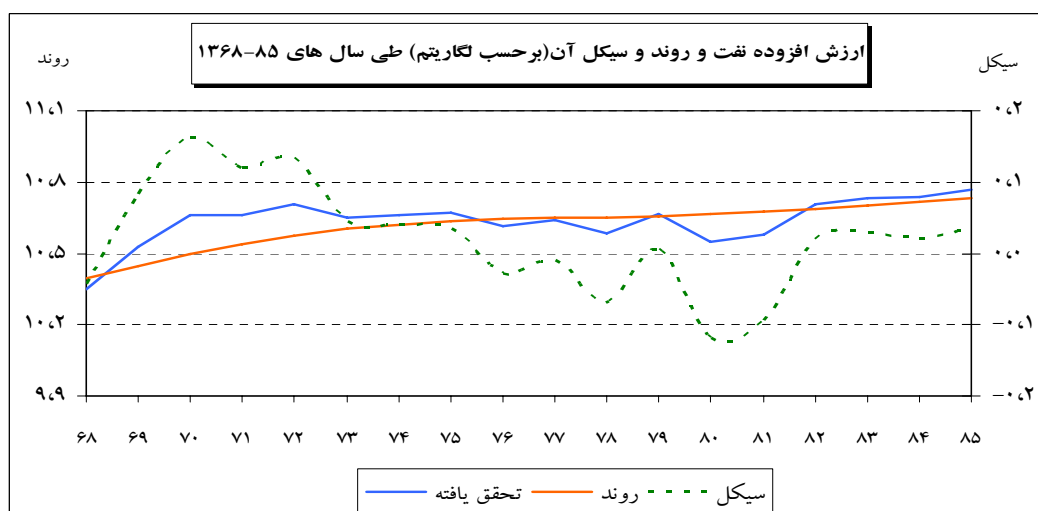
در میان زیربخش‌های اقتصادی، سیکل کشاورزی گرچه از نظر شدت نوسان با سیکل تولید ناخالص در برنامه‌های مختلف متفاوت است، لیکن از نظر روند کلی سیکل و دوران رونق و رکود در مقایسه با سایر بخش‌ها، تشابه زیادی با سیکل تولید ناخالص دارد. به دلیل وابستگی کمتر بخش کشاورزی به درآمدهای ارزی و درونزایی فعالیت‌های آن در تامین تقاضای داخلی، سیکل تولید آن دارای نوسان بسیار اندک بوده است. در سال‌های پایانی برنامه دوم به دلیل خشکسالی شدید در کشور و کاهش تولید واقعی نسبت به تولید بالقوه، نوسان سیکل کشاورزی منفی شده، اما این وضعیت پایدار نبوده است.



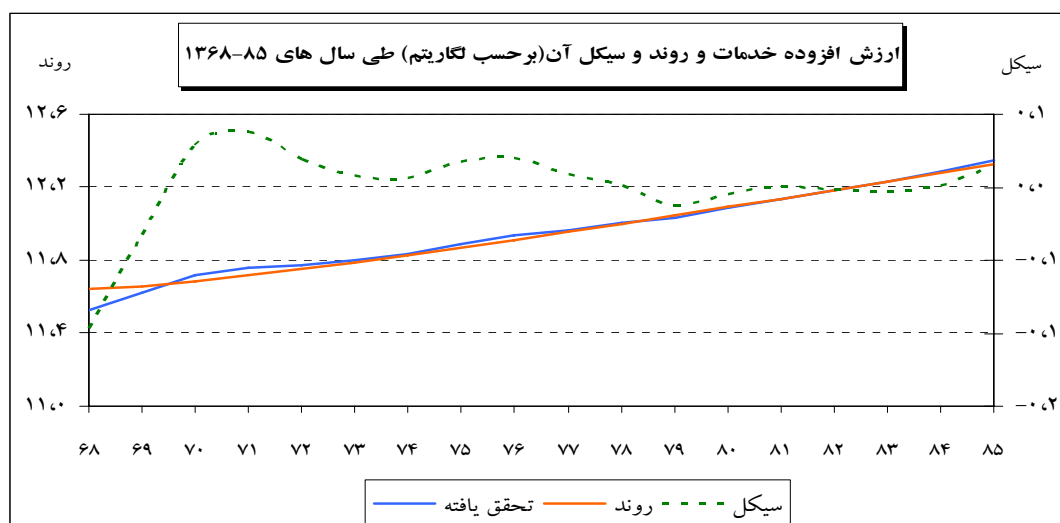
سیکل بخش‌های صنایع و معادن و نفت به ویژه از جهت شدت نوسان و طول دوره رونق و رکود با سیکل تولید ناخالص متفاوت بوده است. به دلیل بحران بدهی‌های ارزی در سال ۱۳۷۴ و کاهش درآمدهای ارزی کشور در سال‌های پس از ۱۳۷۷ تولید بخش صنعت از روند بلندمدت آن کمتر شده و سیکل منفی داشته است. با افزایش تقاضا، سیکل مزبور از سال ۱۳۸۱ مثبت شده است.



بخش نفت نیز در سال‌های پایانی برنامه دوم و ابتدای برنامه سوم سیکل منفی داشته و از سال ۱۳۸۱ به دلیل وجود تقاضای بالا و عدم کاهش سهمیه‌های اوپک با رونق و سیکل مثبت مواجه شده است. مقایسه سیکل اجزای تولید ناخالص داخلی نشان می‌دهد که بخش نفت طولانی‌ترین سیکل منفی را در میان زیربخش‌های اقتصادی داشته است.

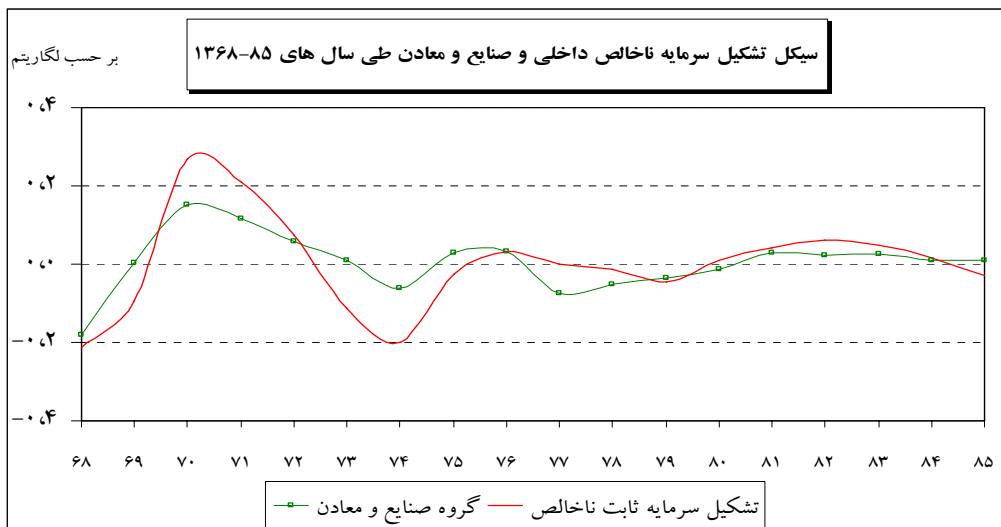


در میان زیربخش‌های اقتصادی، سیکل خدمات به دلیل سهم بالا از تولید ناخالص، تشابه زیادی از نظر نوسان و طول دوره رونق و رکود با سیکل تولید ناخالص داشته، اما در سال‌های پایانی برنامه سوم، سیکل آن تا حدودی متفاوت از تولید ناخالص بوده است. در مجموع می‌توان گفت که بحران ناشی از کاهش شدید درآمدهای نفتی در سال ۱۳۷۷ که منجر به کاهش تقاضا در کشور گردید، دلیل اصلی شکل‌گیری سیکل منفی زیربخش‌های مختلف تولید ناخالص در این مقطع می‌باشد.



در میان اجزای هزینه ناخالص داخلی، سیکل تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در اغلب سال‌های برنامه دوم منفی بوده که ناشی از بحران ارزی در این مقطع بوده است. علی‌رغم اینکه سیکل مزبور از سال ۱۳۸۱ مثبت بوده و با رونق مواجه شده، اما بر خلاف سیکل هزینه ناخالص و اجزای آن در سال ۱۳۸۵ منفی شده که عمدتاً ناشی از افزایش ریسک انجام سرمایه‌گذاری و کاهش عملکرد در مقایسه با روند بلندمدت می‌باشد. این در حالی است که با افزایش درآمدهای ارزی کشور در سال‌های اخیر، منابع مالی فراوان به بخش‌های تولیدی تزریق شده و همچنین، میزان واردات نیز بالا بوده است.

در بین اجزای تولید و هزینه ناخالص داخلی، میان بخش صنایع و معادن و تشکیل سرمایه ثابت ناخالص از نظر روند کلی سیکل، میزان نوسان و طول دوره رونق و رکود، تشابه و همسویی زیادی وجود دارد.



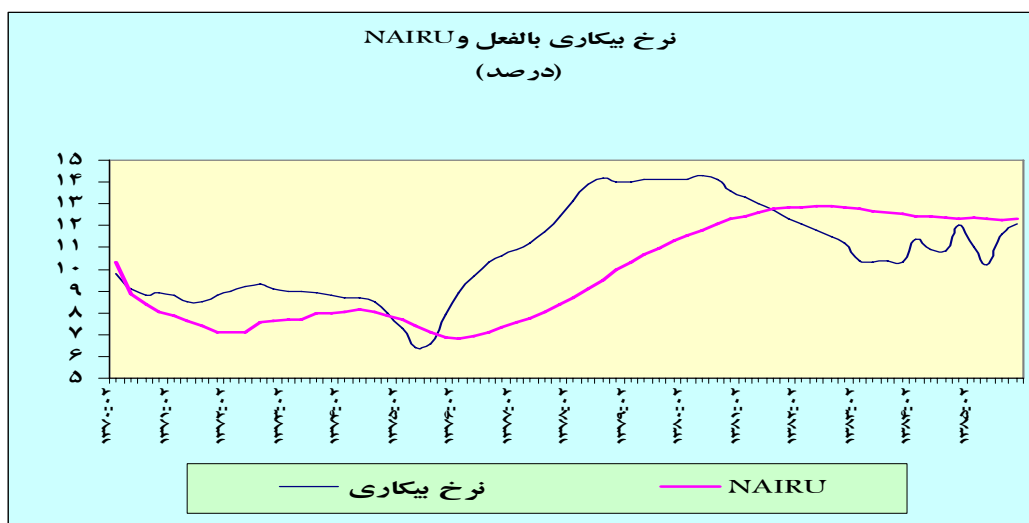
۶- روند بیکاری و رشد اقتصادی

افزایش اشتغال در بخش‌های مولد و تولیدی و تداوم آن از عوامل اصلی دستیابی به رشد اقتصادی پایدار در بلندمدت بوده و از اهداف کلان اقتصادی به شمار می‌آید. علی‌رغم این، بررسی وضعیت نیروی کار نشان می‌دهد که نرخ بالای بیکاری از مشکلات جدی و چالشی اقتصاد کشور است. این نرخ در مناطق شهری به ویژه در میان اقشار جوان تحصیل کرده و زنان بیشتر است. همچنین از چالش‌های بازار کار، فضای بسته و عدم آزادسازی قوانین و مقررات ناظر بر آن می‌باشد که تقاضای بازار را غیر منعطف و با مشکل مواجه ساخته است.

وضعیت بیکاری طی دوره مطالعه نشان می‌دهد که در سال‌های برنامه اول و ابتدای برنامه دوم، روند بلندمدت بیکاری نزولی بوده و به کمترین مقدار خود در سال ۱۳۷۵ رسیده است. ورود نیروی کار جدید و عمدتاً تحصیل کرده به بازار که با وقفه نسبتاً طولانی صورت گرفته، مجدداً نرخ بیکاری را در سطوح بالایی قرار داده است.

با افزایش تولید بالفعل و جذب بخشی از نیروی کار بیکار که با تزریق منابع مالی زیاد و افزایش میزان تشکیل سرمایه به ویژه در بخش صنایع و معادن صورت گرفته، روند بیکاری از سال‌های پایانی برنامه سوم کاهش شده است. از آنجا که این کاهش به شکل ساختاری نبوده و از محل افزایش تولید بالقوه صورت نگرفته بیکاری در سال‌های اخیر روند افزایشی داشته است.

مقایسه روند بلندمدت و عملکرد جاری نرخ بیکاری



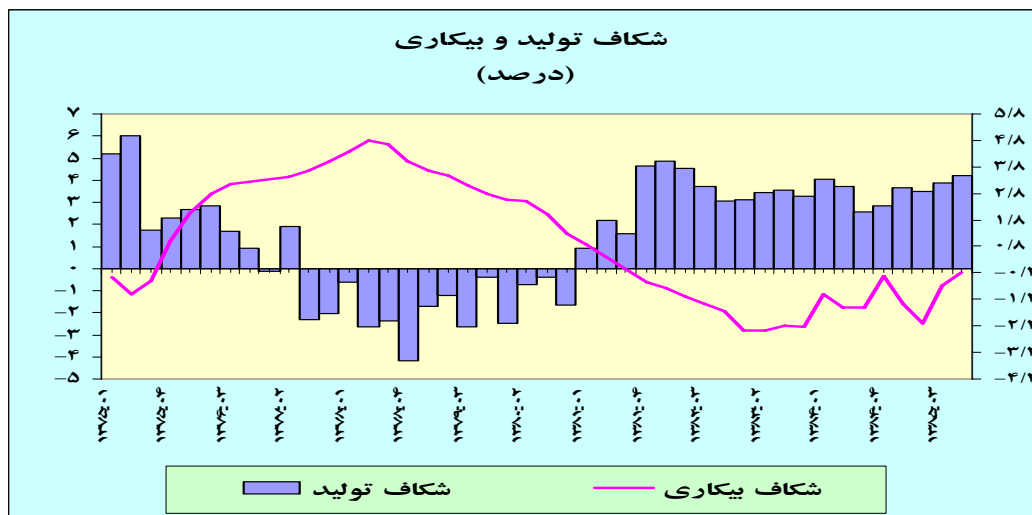
ساختار جمعیتی جوان و افزایش روزافزون نسبت جمعیت بالقوه فعال ناشی از نرخ بالای رشد جمعیت در سال‌های ۶۵-۱۳۵۵ که سبب شده عرضه نیروی کار روند فزاینده داشته باشد از یک سو و رشد اندک تقاضای نیروی کار که از مشکلات ساختاری بخش واقعی در مسائلی نظیر سرمایه‌گذاری‌های جدید، تولید و قوانین مربوطه ناشی می‌شود از دلایل افزایش نرخ بیکاری بوده است.

با توجه به بررسی‌ها و مطالعات صورت گرفته در رابطه با شکاف بیکاری و تولید، آنچه می‌بایست به شکل ساختاری کاهش یابد تا اثر پایداری بر رشد اقتصادی داشته باشد، کاهش نرخ بیکاری تعادلی^۱ (نرخ بیکاری در سطح تورم غیرشتابان) است. زیرا، انجام سیاست‌های اقتصادی صرف طرف تقاضا برای ایجاد اشتغال، گرچه در کوتاه‌مدت موجب انحراف نرخ بیکاری از روند بلندمدت آن می‌گردد، اما نهایتاً نرخ بیکاری در میان‌مدت و بلندمدت افزایش می‌یابد.

به عبارت دیگر، چنانچه اصلاحات ساختاری در قوانین کار و دستمزدها و نیز نظام تامین اجتماعی صورت گیرد و روند آموزش و بهره‌وری نیروی کار متناسب با ظرفیت تولید و میزان جذب سرمایه در اقتصاد باشد، نرخ بیکاری به شکل پایدار کاهش خواهد یافت. علاوه بر این با رفع موانع تولید و سرمایه‌گذاری (از طریق ساماندهی فضای کسب

۱- Non-Accelerating Inflation Rate of Unemployment (NAIRU)

وکار در کشور)، کاهش ریسک سرمایه‌گذاری (از طریق فراهم نمودن امنیت اقتصادی و سیاسی) و ایجاد هماهنگی بین نظام آموزشی و نیازهای بازار کار می‌توان وضعیت بازار کار و اشتغال را ساماندهی و بهبود بخشید.



شکاف تولید و بیکاری

۱۳۸۵	۱۳۸۴	۱۳۸۳	۱۳۸۲	۱۳۸۱	۱۳۸۰	درصد
۶,۲	۵,۷	۵,۱	۷,۱	۷,۵	۳,۷	رشد تولید بالفعل
۴,۹	۵,۴	۵,۷	۴,۸	۳,۸	۳,۶	رشد تولید بالقوه
۳,۷	۳,۲	۳,۲	۴,۰	۲,۰	-۱,۸	شکاف تولید
۱۱,۲	۱۱,۳	۱۰,۴	۱۱,۷	۱۲,۸	۱۴,۰	نرخ بیکاری
۱۲,۳	۱۲,۴	۱۲,۶	۱۲,۹	۱۲,۷	۱۱,۹	NAIRU
-۱,۱	-۱,۱	-۲,۳	-۱,۲	۰,۲	۲,۱	شکاف بیکاری

۷- همبستگی اجزای تولید و هزینه ناخالص

محاسبه ضریب همبستگی اجزای تولید ناخالص داخلی در دوره مورد بررسی نشان می‌دهد که میان ارزش افزوده بخش کشاورزی با صنایع و معادن و خدمات و همچنین بخش صنایع و معادن و خدمات ضریب همبستگی بالایی وجود دارد.

از آنجا که بخشی از بالا بودن ضریب همبستگی ارزش افزوده بخش‌های اقتصادی به پدیده هم‌روندی (Co trend) متغیرها مربوط می‌گردد، لذا پس از بررسی ایستایی متغیرها، ضریب همبستگی رشد آنها مورد بررسی قرار گرفته است. مطابق ضرایب محاسبه شده جدید در میان زیربخش‌های تولید ناخالص، بیشترین ضریب همبستگی مربوط به بخش صنایع و معادن با بخش خدمات بوده است. همچنین، کمترین ضریب مربوط به بخش صنایع و معادن با کشاورزی می‌باشد. پایین بودن این ضریب می‌تواند ناشی از سنتی بودن بخش کشاورزی و عدم مکانیزاسیون و توسعه کشاورزی صنعتی در کشور باشد. این در حالی است که بخش نفت با همه بخش‌های اقتصادی از ضریب همبستگی نسبتاً بالایی برخوردار بوده است.

ماتریس همبستگی سطح متغیرهای اجزای تولید ناخالص داخلی به قیمت ثابت ۷۶

عنوان	کشاورزی	صنایع و معادن	نفت	خدمات	تولید ناخالص داخلی
کشاورزی	۱،۰۰	۰،۹۷	۰،۶۹	۰،۹۸	۰،۹۹
صنایع و معادن	۰،۹۷	۱،۰۰	۰،۶۲	۰،۹۹	۰،۹۹
نفت	۰،۶۹	۰،۶۲	۱،۰۰	۰،۶۱	۰،۶۶
خدمات	۰،۹۸	۰،۹۹	۰،۶۱	۱،۰۰	۱،۰۰
تولید ناخالص داخلی	۰،۹۹	۰،۹۹	۰،۶۶	۱،۰۰	۱،۰۰

ماتریس همبستگی سطح متغیرهای اجزای هزینه ناخالص داخلی به قیمت ثابت ۷۶

عنوان	مصرف دولتی	مصرف خصوصی	تشکیل سرمایه ناخالص	واردات	صادرات	هزینه ناخالص داخلی
مصرف دولتی	۱،۰۰	۰،۹۰	۰،۸۳	۰،۴۰	۰،۹۱	۰،۹۳
مصرف خصوصی	۰،۹۰	۱،۰۰	۰،۹۸	۰،۵۸	۰،۸۵	۰،۹۹
تشکیل سرمایه ناخالص	۰،۸۳	۰،۹۸	۱،۰۰	۰،۶۶	۰،۸۲	۰،۹۶
واردات	۰،۴۰	۰،۵۸	۰،۶۶	۱،۰۰	۰،۴۹	۰،۵۶
صادرات	۰،۹۱	۰،۸۵	۰،۸۲	۰،۴۹	۱،۰۰	۰،۸۹
هزینه ناخالص داخلی	۰،۹۳	۰،۹۹	۰،۹۶	۰،۵۶	۰،۸۹	۱،۰۰

ماتریس همبستگی رشد اجزای تولید ناخالص داخلی به قیمت ثابت ۷۶

عنوان	کشاورزی	صنایع و معادن	نفت	خدمات	تولید ناخالص داخلی
کشاورزی	۱،۰۰	۰،۰۸	۰،۵۷	۰،۳۲	۰،۵۴
صنایع و معادن	۰،۰۸	۱،۰۰	۰،۴۳	۰،۷۷	۰،۸۲
نفت	۰،۵۷	۰،۴۳	۱،۰۰	۰،۴۹	۰،۷۸
خدمات	۰،۳۲	۰،۷۷	۰،۴۹	۱،۰۰	۰،۸۹
تولید ناخالص داخلی	۰،۵۴	۰،۸۲	۰،۷۸	۰،۸۹	۱،۰۰

ماتریس همبستگی رشد اجزای هزینه ناخالص داخلی به قیمت ثابت ۷۶

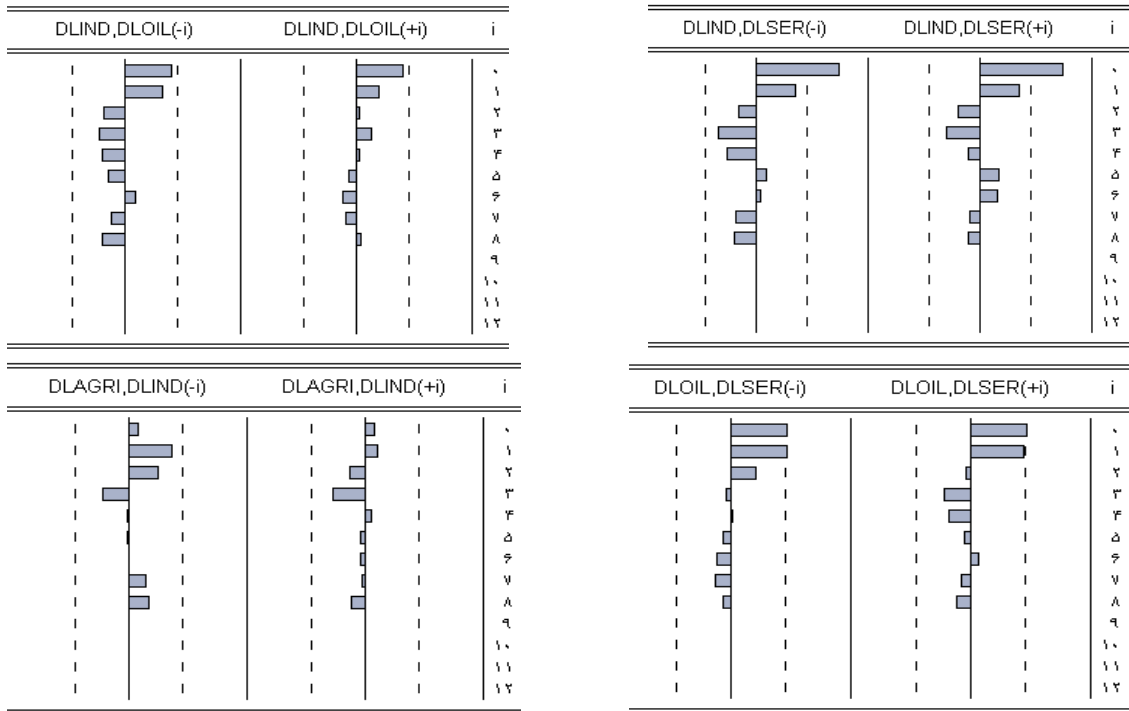
عنوان	مصرف دولتی	مصرف خصوصی	تشکیل سرمایه ناخالص	واردات	صادرات	هزینه ناخالص داخلی
مصرف دولتی	۱،۰۰	۰،۳۱	-۰،۱۲	-۰،۰۶	۰،۴۲	۰،۲۵
مصرف خصوصی	۰،۳۱	۱،۰۰	۰،۴۹	۰،۴۹	۰،۳۷	۰،۲۳
تشکیل سرمایه ناخالص	-۰،۱۲	۰،۴۹	۱،۰۰	۰،۷۹	۰،۲۵	۰،۳۵
واردات	-۰،۰۶	۰،۴۹	۰،۷۹	۱،۰۰	۰،۲۱	۰،۵۶
صادرات	۰،۴۲	۰،۳۷	۰،۲۵	۰،۲۱	۱،۰۰	۰،۵۰
هزینه ناخالص داخلی	۰،۲۵	۰،۲۳	۰،۳۵	۰،۵۶	۰،۵۰	۱،۰۰

علاوه بر ضریب همبستگی اجزای تولید ناخالص داخلی، همبستگی پسین و پیشین (Lead and Lag) اجزای تولید ناخالص نیز از شاخص‌های آماری مهمی است که در تحلیل روابط میان بخش‌های اقتصادی حائز اهمیت است. محاسبه ضریب مذکور در دوره مورد بررسی حاکی از آن است که میان بخش‌های صنایع و معادن و نفت با بخش خدمات و بخش‌های صنایع و معادن با بخش نفت یک الگوی مشخص و مشابه وجود داشته است. به گونه‌ای که نوسانات بخش نفت در دوره‌های قبل، بخشی از تغییرات جاری بخش‌های صنایع و خدمات را تبیین نموده که در بخش صنایع عمدتاً می‌تواند از طریق بخش ساختمان باشد.

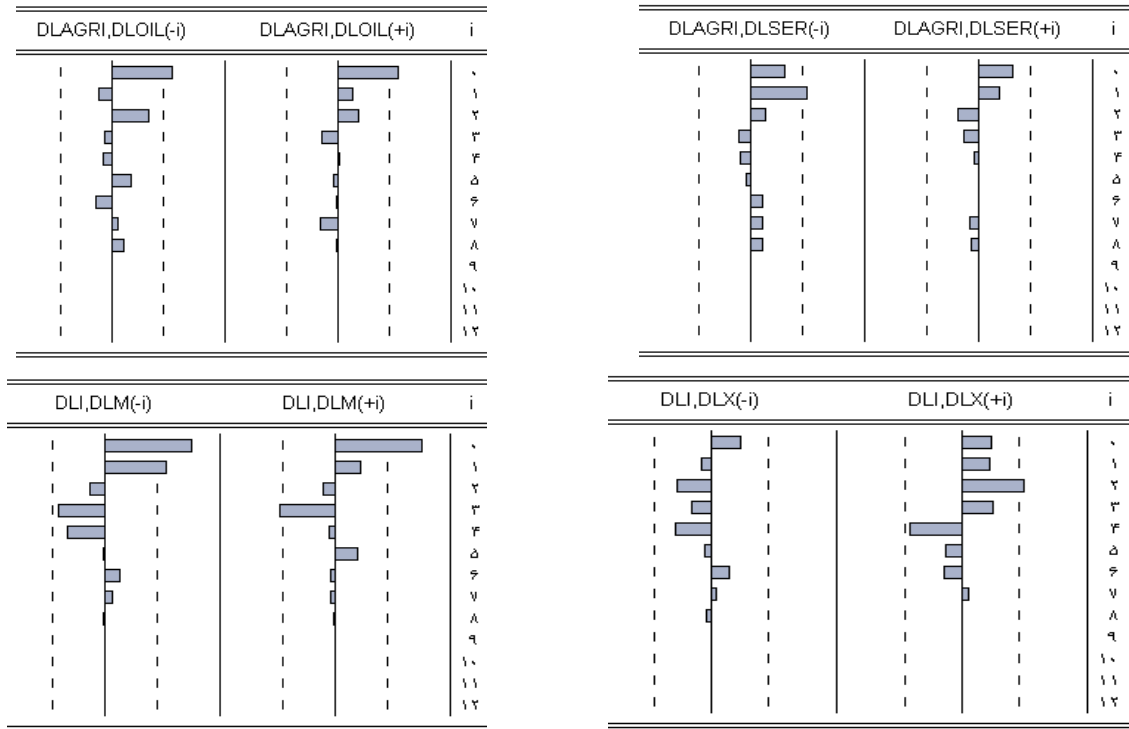
علاوه بر این، بخشی از تغییرات جاری بخش خدمات نیز ناشی از نوسانات بخش صنایع و معادن در دوره قبل بوده که این رابطه متقابل می‌باشد. براین اساس، می‌توان گفت که رونق بخش نفت، رونق بخش‌های صنعت و خدمات را تبیین نموده است. همچنین، مطابق ضرایب مزبور بخشی از تغییرات و رشد بخش کشاورزی ناشی از عملکرد بخش خدمات در دوره قبل است. به عبارت دیگر، رشد خدمات می‌تواند بخشی از عملکرد رشد کشاورزی را هدایت نموده و موجب پیشرفت آن شود که این رابطه متقابل است.

ضریب همبستگی پسین و پیشین زیربخش‌های تشکیل سرمایه ناخالص و واردات نیز نشان می‌دهد که بخشی از عملکرد رشد تشکیل سرمایه در دوره جاری ناشی از واردات دوره‌های قبل بوده و متقابلاً تقاضا برای تشکیل سرمایه در دوره جاری نیز بخشی از رشد واردات دوره بعد را تبیین می‌نماید.

همبستگی پسین و پیشین رشد اجزای تولید ناخالص داخلی



همبستگی پسین و پیشین رشد اجزای تولید و هزینه ناخالص داخلی

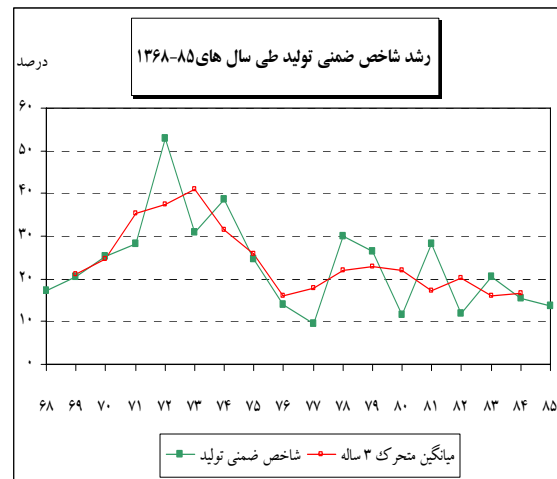
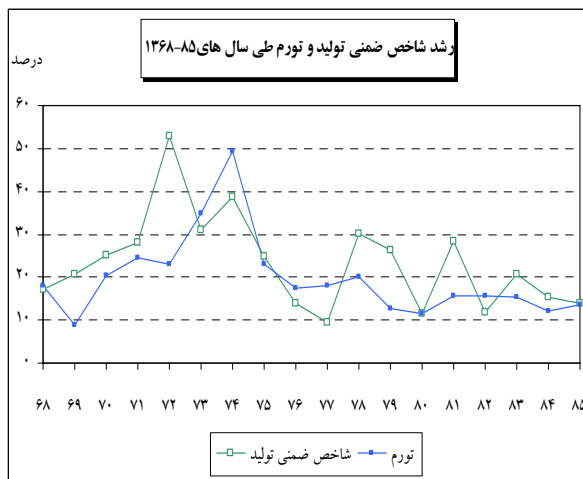


۸- شاخص ضمنی تولید

شاخص ضمنی تولید بیانگر میزان افزایش قیمت کالاها و خدمات تولید شده می‌باشد. به دلیل اجرای سیاست تعدیل اقتصادی، افزایش نرخ ارز و شکل‌گیری انتظارات تورمی در جامعه در برنامه اول توسعه، این شاخص روندی صعودی داشته و به بیشترین مقدار خود در سال ۱۳۷۲ رسیده است. با اجرای سیاست تثبیت اقتصادی و تثبیت نرخ ارز در برنامه دوم توسعه از انتظارات تورمی جامعه تا حدودی کاسته شده و شاخص مزبور روند کاهنده یافته است.

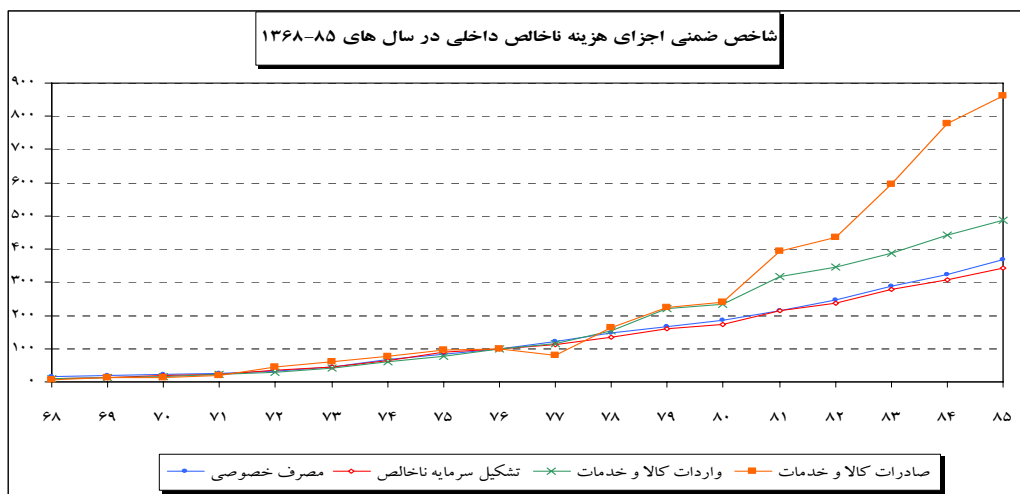
افت شدید قیمت جهانی نفت و کاهش درآمدهای ارزی کشور در سال ۱۳۷۷ که به کاهش تولید منجر گردید، موجب شد تا تقاضای جامعه به میزان مناسب تأمین نگردیده و به تبع آن قیمت‌ها افزایش یابد. این وضعیت سبب شد تا شاخص مزبور مجدداً افزایش یافته و از نوسان بیشتری برخوردار گردد. لیکن در سال‌های اخیر، روند کلی آن کاهنده بوده و از ثبات بیشتری برخوردار شده است.

مقایسه رشد شاخص ضمنی با تورم نشان می‌دهد که شاخص ضمنی از نوسان بیشتری برخوردار بوده که غالباً ناشی از نوسانات قیمت نفت و شاخص قیمت واردات است. این امر مؤید این است که در انجام برنامه‌ریزی‌های اقتصادی، نرخ تورم باثبات و مناسب‌تر می‌باشد.



بررسی اجزای شاخص ضمنی هزینه ناخالص نشان می‌دهد که در طول دوره مورد مطالعه بر سهم شاخص ضمنی واردات و صادرات در رشد شاخص ضمنی کل افزوده شده است. در میان اجزای شاخص مزبور شاخص ضمنی واردات کالا و خدمات از سال ۱۳۷۹ افزایش شدیدی یافته که عمدتاً ناشی از افزایش قیمت جهانی کالاهای وارداتی می‌باشد.

به دلیل افت شدید قیمت جهانی نفت در سال ۱۳۷۷ شاخص ضمنی صادرات کالاها و خدمات نیز با کاهش مواجه گردید. این شاخص در سال‌های ۸۰-۱۳۷۸ افزایش یافته که ناشی از زیربخش صادرات غیر نفتی می‌باشد. اما، رشد چشمگیر آن که از سال ۱۳۸۰ آغاز گردیده به دلیل افزایش قیمت جهانی نفت بوده و در واقع یک شکست ساختاری در روند آن محسوب می‌گردد. علی‌رغم این، رشد شاخص ضمنی هزینه‌های مصرفی خصوصی از روند صعودی نسبتاً باثباتی برخوردار بوده است. چنانچه رشد این شاخص و تورم مقایسه شود، ملاحظه می‌گردد که دو شاخص در طول دوره مورد بررسی انطباق کامل داشته‌اند.

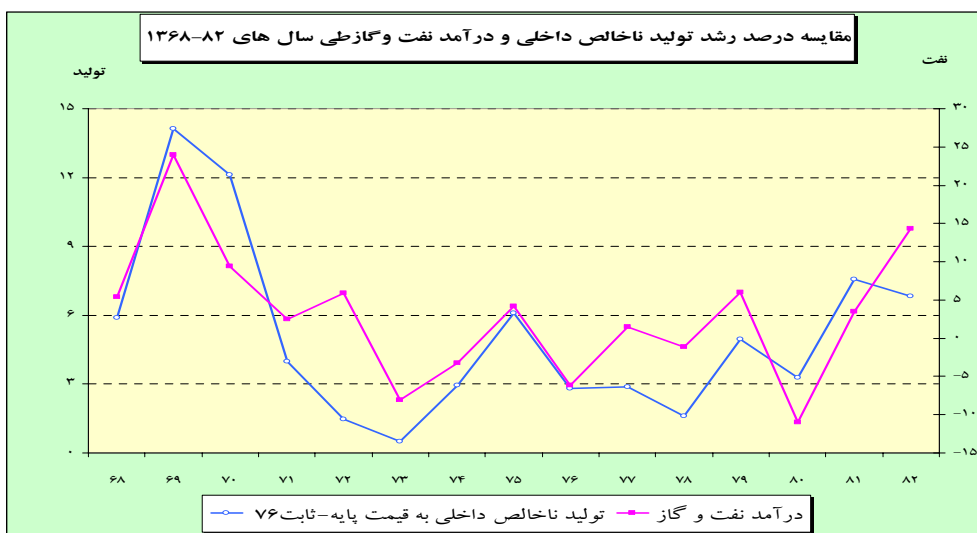


۹- درآمدهای نفتی، مصرف انرژی و رشد اقتصادی

اتکای بیش از حد به درآمدهای نفتی از شاخصه‌های اصلی اقتصاد کشور در طول دوره مورد بررسی می‌باشد. به گونه‌ای که میزان اتکای اقتصاد کشور به درآمدهای نفتی و سهم ارزش افزوده آن طی سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ (بجز سال ۱۳۷۷) روندی فزاینده داشته و از حدود ۱۱ درصد به حدود ۲۷ درصد رسیده و حدود

۲/۵ برابر شده است. افزایش فوق‌العاده قیمت نفت در سال‌های اخیر عامل اصلی آن بوده است.

همانگونه که در سایر مطالعات انجام شده نیز بیان گردیده است، ساختار اقتصادی مبتنی بر وفور منابع طبیعی (عمدتاً نفت) به عنوان مانعی جدی در مسیر رشد بالای اقتصادی و توسعه صنعتی عمل کرده و با افزایش بی‌سابقه قیمت جهانی نفت در سال‌های اخیر به بیشترین مقدار رسیده است.



ضریب همبستگی تولید ناخالص داخلی و درآمد حاصل از صادرات نفت و گاز

بر اساس رشد GDP و رشد درآمد های نفتی به قیمت های ثابت ۷۶	دوره
۰،۸۱	برنامه اول (۱۳۶۸-۷۲)
۰،۶۳	برنامه دوم (۱۳۷۴-۷۸)
۰،۷۵	برنامه سوم (۱۳۷۹-۸۳)
NA	برنامه چهارم (۱۳۸۴-۸۵) (۱)
۰،۷۹	کل دوره (۱۳۶۸-۸۲)

۱- به دلیل عدم وجود ارقام درآمدهای نفتی به قیمت های ثابت برای سال های ۱۳۸۳-۸۵ در آمار حساب های ملی، ضریب همبستگی مربوطه محاسبه نشده است.

در دوره مورد بررسی، رشد اقتصادی با رشد درآمدهای نفتی ارتباط نزدیکی داشته است. به گونه‌ای که ضریب همبستگی این دو متغیر علی‌رغم نوسان اندکی که در طول برنامه‌های توسعه داشته است به دلیل افزایش میزان درآمدهای ارزی حاصله در حدود ۰/۸ بوده است.

به دلیل ارزان بودن قیمت انرژی در کشور، سرانه مصرف آن برای تولید یک واحد از تولید ناخالص داخلی روندی افزایشی داشته است. به طوری که شدت انرژی در ایران در مقایسه با کشورهای جهان بسیار بالا بوده و در رتبه دوم قرار دارد. با افزایش قیمت جهانی نفت، وضعیت مزبور وخیم‌تر شده و موجب عدم کارایی و صرفه اقتصادی تولید در برخی صنایع کشور گردیده است.

علی‌رغم اینکه در سال‌های گذشته شدت انرژی در ایران با نوسانات اندک روندی کاهنده داشته و از رقم ۲/۰۵ (بشکه معادل نفت خام به ازای یک میلیون ریال تولید ناخالص داخلی به قیمت ثابت ۷۶) در سال ۱۳۷۶ به حدود ۱/۹۱ در سال ۱۳۸۲ رسیده است، لیکن از سال ۱۳۸۳ و سال‌های ابتدای برنامه چهارم مجدداً روند افزایشی داشته است. به گونه‌ای که در سال ۱۳۸۵ رقم مزبور به میزان ۲/۰۸ بوده است. طی سال‌های مورد بررسی، شدت انرژی تنها در بخش کشاورزی روند کاهنده داشته و در بخش حمل و نقل (بجز سال ۱۳۸۵) عمدتاً روند آن صعودی بوده است.

شدت انرژی به تفکیک بخش‌های کشاورزی و حمل و نقل

(بشکه معادل نفت خام به میلیون ریال)

سال	کشاورزی	حمل و نقل	کل کشور (۱)
۱۳۷۶	۰،۶۹	۷،۰۹	۲،۰۵
۱۳۷۷	۰،۶۹	۷،۳۰	۲،۰۲
۱۳۷۸	۰،۶۸	۶،۸۰	۲،۰۹
۱۳۷۹	۰،۶۷	۷،۰۰	۱،۹۴
۱۳۸۰	۰،۶۸	۷،۰۹	۱،۹۴
۱۳۸۱	۰،۵۹	۷،۴۷	۱،۹۵
۱۳۸۲	۰،۵۹	۷،۴۱	۱،۹۱
۱۳۸۳	۰،۵۹	۷،۴۶	۱،۹۶
۱۳۸۴	۰،۵۶	۷،۵۱	۲،۰۳
۱۳۸۵	۰،۵۹	۷،۰۰	۲،۰۸

مأخذ: ترازنامه انرژی سال ۱۳۸۵

۱- شدت انرژی بر اساس مصرف نهایی محاسبه شده است.

شدت انرژی در کشورها و مناطق مختلف جهان در سال ۲۰۰۴

نام کشور یا گروه کشورها	مصرف نهایی انرژی (میلیون بشکه معادل نفت خام)	بشکه معادل نفت خام برای ۱۰۰۰ دلار GDP بر اساس نرخ ارز	بشکه معادل نفت خام برای ۱۰۰۰ دلار GDP بر اساس برابری قدرت خرید
OECD	۲۵۱۹۶،۱۴	۰،۹۱	۰،۸۵
آمریکای شمالی	۱۲۵۴۶،۷۶	۱،۰۴	۱،۰۰
ژاپن	۲۲۸۱،۸۳	۰،۴۶	۰،۶۶
کره	۸۱۸،۷۶	۱،۳۴	۰،۸۹
ترکیه	۴۳۱،۰۰	۱،۸۸	۰،۸۲
آسیا (بدون چین)	۶۲۶۲،۰۲	۳،۴۴	۰،۹۲
آفریقا	۳۰۵۵،۱۴	۴،۴۶	۱،۵۳
خاورمیانه	۲۰۷۴،۳۹	۲،۸۰	۱،۶۲
شوروی سابق	۴۳۸۴،۰۷	۸،۹۴	۲،۲۰
چین و هنگ کنگ	۷۰۳۱،۶۷	۳،۶۹	۰،۹۷
هند	۲۷۶۴،۱۴	۴،۷۶	۰،۸۹
پاکستان	۴۲۶،۶۱	۴،۹۵	۱،۳۷
عربستان	۴۸۳،۷۸	۲،۲۵	۱،۵۹
ونزوئلا	۲۶۵،۳۵	۲،۲۱	۱،۸۳
ایران	۷۸۸،۷۱	۶،۲۴	۱،۷۰
جهان	۵۱۰۵۷،۱۲	۱،۴۶	۰،۹۸

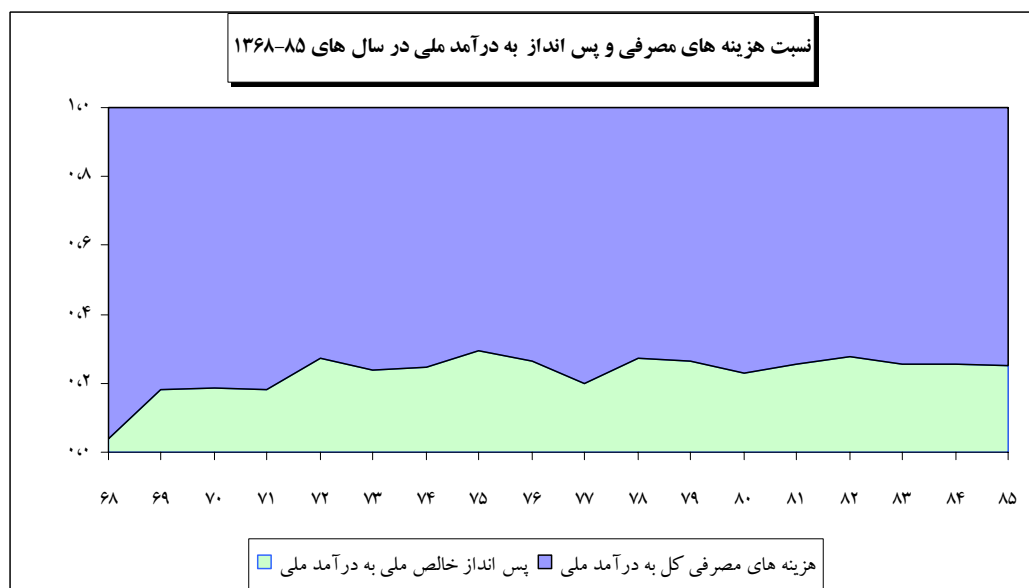
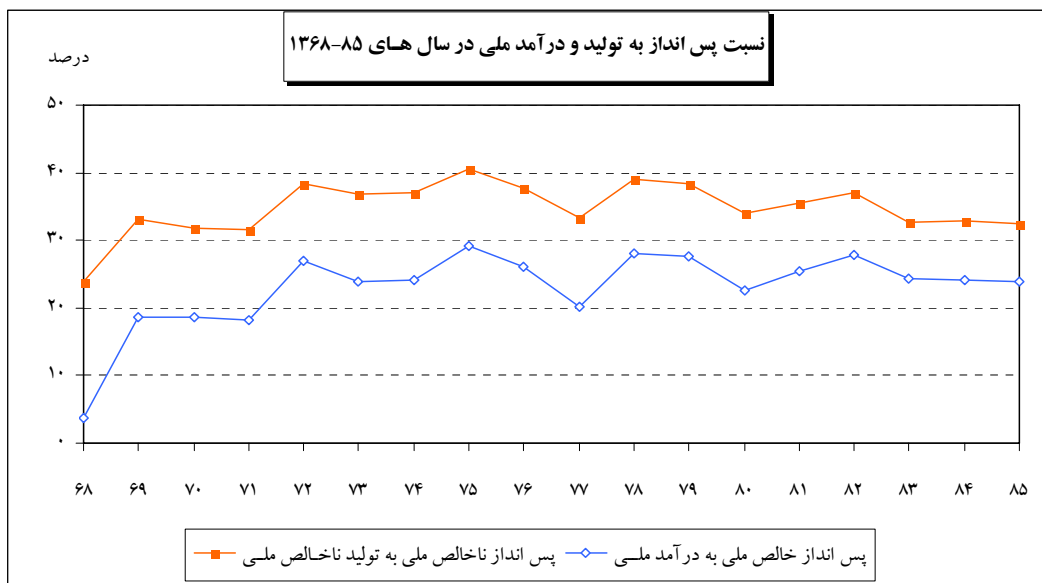
مأخذ: IEA, International Energy Agency, Energy Balances of OECD Countries, ۲۰۰۳-۲۰۰۴, ۲۰۰۶ Edition

۱۰- پس‌انداز ملی

پس‌انداز ملی و نسبت آن به تولید ناخالص از شاخص‌های اساسی اقتصاد است که میزان تمایل مردم به پس‌انداز را نشان می‌دهد. طی سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ پس‌انداز ناخالص ملی از رشد متوسط ۱۰/۲ درصد در سال برخوردار شده، لیکن ضریب پراکندگی آن نسبتاً بالا بوده است. علاوه بر این در برخی سال‌های برنامه دوم و سوم توسعه، پس‌انداز کشور رشد منفی نیز داشته و پرنوسان بوده است. عدم ثبات سیاست‌های اقتصادی دولت، تشدید نوسانات نرخ ارز و تورم و نظایر آن که از سال‌های پایانی برنامه اول آغاز گردید از دلایل اصلی کاهش رشد پس‌انداز به شمار می‌آید.

نسبت پس‌انداز به تولید ناخالص طی سال‌های برنامه دوم و سوم (بجز سال ۱۳۷۷ که به دلیل افت قیمت جهانی نفت موجب کاهش درآمد و پس‌انداز کشور گردید) نسبتاً بهبود یافته و تا حدودی تثبیت شده است. اما نسبت به سال‌های برنامه دوم کاهش نشان می‌دهد.

علاوه براین، نسبت پس انداز خالص به درآمد ملی از دیگر نسبت‌های مهم جهت بررسی وضعیت پس انداز جامعه می‌باشد. نسبت مزبور نشان می‌دهد که سهم پس انداز خالص از درآمد ملی در مقایسه با سهم هزینه‌های مصرفی در برنامه‌های سوم و چهارم نسبت به برنامه اول توسعه بهبود یافته است. لیکن، متوسط آن از حدود ۲۵ درصد فراتر نرفته است. این در حالی است که جهت افزایش رشد اقتصادی و رفع معضل بیکاری، لازم است نسبت مزبور افزایش یافته و به طور مستمر تداوم داشته باشد.



مقایسه نوسانات (ضریب پراکندگی) رشد پس‌انداز ملی و هزینه‌های مصرفی در سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ نشان می‌دهد که رفتار مصرفی جامعه از ثبات بیشتری در مقایسه با پس‌انداز ملی برخوردار بوده است. این بدین معنی است که مصرف جامعه به دلیل لختی و اینرسی زیاد با هر تغییر موقت در درآمد ملی به کندی تعدیل می‌شود.

علاوه بر این، مقایسه نسبت‌های پس‌انداز خالص ملی به درآمد ملی و هزینه‌های مصرفی کل (خصوصی و دولتی) به درآمد ملی، بیانگر این است که در برنامه دوم از سهم هزینه‌های مصرفی کاسته شده و بر سهم پس‌انداز افزوده شده است. اما در سال‌های پس از آن، نسبت‌های مزبور بهبود محسوسی نداشته و حتی کاهش نیز یافته‌اند. این در حالی است که در شرایط طبیعی اقتصاد، کاهش روند هزینه‌های مصرفی از عوامل اصلی تجهیز پس‌اندازهای جامعه بوده و در صورت برنامه‌ریزی صحیح و به کارگیری سیاست‌های مناسب، منابع حاصله می‌تواند به سمت فعالیت‌های تولیدی مولد سوق یافته و به تشکیل سرمایه منجر گردد. شایان ذکر است که نسبت‌های مزبور در طول دوره مورد بررسی به ترتیب حدود ۲۳ و ۷۷ درصد بوده است.

نسبت‌های مربوط به پس‌انداز ملی (به قیمت ثابت ۷۶) درصد

عنوان	کل دوره	متوسط برنامه		
		اول	دوم	چهارم
پس‌انداز ناخالص ملی به تولید ناخالص ملی	۳۴٫۸	۳۱٫۸	۳۷٫۶	۳۲٫۶
پس‌انداز خالص ملی به درآمد ملی	۲۳٫۰	۱۷٫۲	۲۵٫۵	۲۴٫۰
تشکیل سرمایه ناخالص به پس‌انداز ناخالص ملی	۸۶٫۰	۹۳٫۴	۷۳٫۰	۹۸٫۴
هزینه‌های مصرفی کل به درآمد ملی	۷۶٫۵	۸۳٫۰	۷۴٫۶	۷۰٫۶

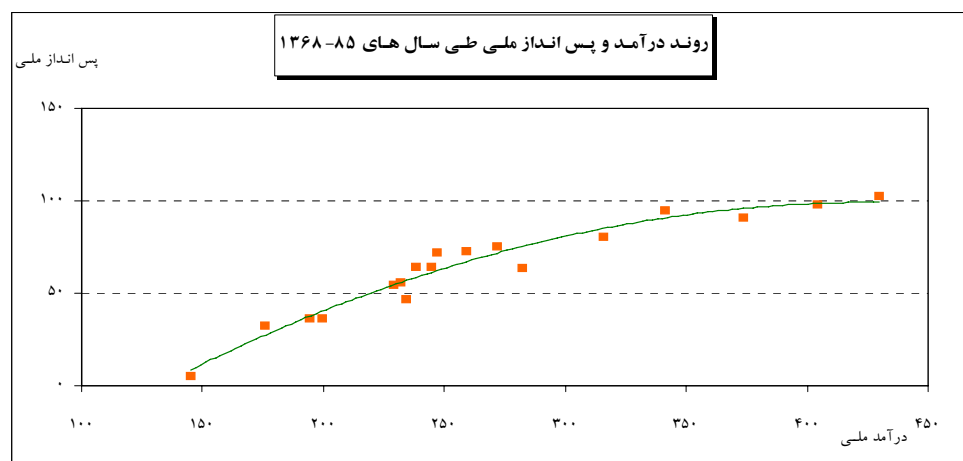
عوامل سیاستی و غیر سیاستی نظیر سیاست‌های دولت، مالیات، ترتیبات نظام تأمین اجتماعی، نرخ سود، توسعه بازارهای مالی و ثبات کلان اقتصادی، تورم، ویژگی‌های جمعیتی، رشد، توزیع درآمد، الگوی مصرف، عوامل خارجی و نظایر آن از عوامل مؤثر بر پس‌انداز جامعه محسوب می‌شوند. علی‌رغم این بر اساس مطالعات انجام گرفته، تعمیق و بهبود بازارهای مالی مطمئن‌ترین راه افزایش پس‌انداز جامعه می‌باشد. لیکن، وضعیت بورس اوراق بهادار کشور در سال‌های گذشته مطلوب نبوده و این امر از عوامل اصلی عدم تجهیز مناسب پس‌انداز و تشکیل سرمایه در جامعه محسوب می‌گردد. در این میان، تورم، رشد اقتصادی و درآمد سرانه نامطلوب هم از عوامل دیگری است که مؤثر بوده است.

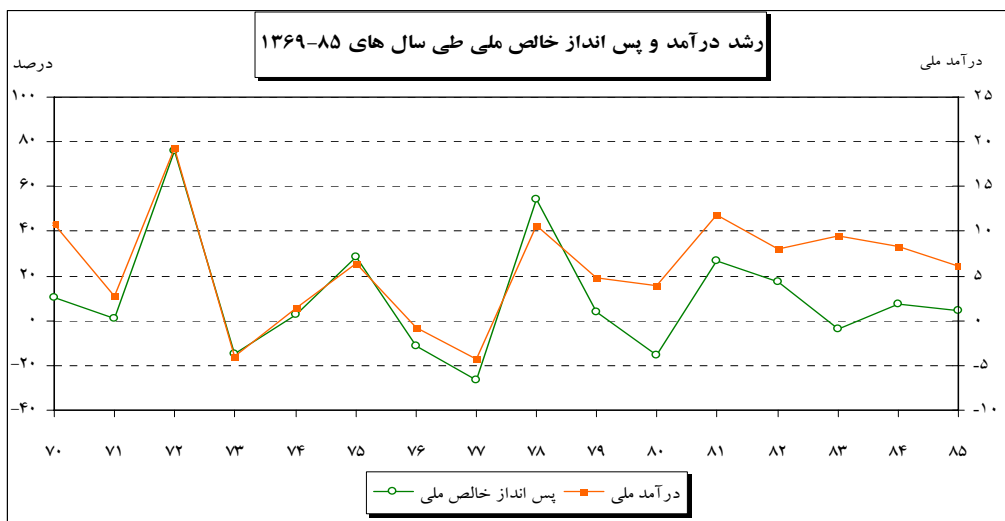
بررسی روند رشد پس‌انداز ناخالص و رشد درآمد ملی در دوره مورد بررسی بیانگر رابطه همسو میان آنهاست. چنانچه رشد درآمد سرانه سریع‌تر باشد، می‌توان انتظار داشت که نرخ پس‌انداز نیز بالا باشد. همچنین، هرگونه افزایش در تولید، مستلزم کاهش جذب داخلی و افزایش پس‌انداز جامعه است. براین اساس برنامه‌ریزی و سیاستگذاری جهت افزایش تولید و رشد درآمد می‌بایست با افزایش پس‌انداز و هدایت آن به سمت فعالیت‌ها و سرمایه‌گذاری‌های مولد صورت گیرد.

روند رشد تولید و پس‌انداز ناخالص و همچنین، درآمد و پس‌انداز خالص ملی در دوره مورد بررسی نشان می‌دهد که در سال‌های برنامه اول و دوم توسعه، روند رشد هر دو متغیر کاهنده، اما متناسب بوده است. از برنامه سوم توسعه، رشد پس‌انداز از نوسان و میانگین کمتری در مقایسه با قبل برخوردار بود. لیکن، میانگین رشد تولید ناخالص افزایش داشته و در دامنه بالاتری قرار گرفته و نوسان آن نیز کمتر شده است.

وضعیت فوق بیانگر اینست که نرخ رشد پس‌انداز در سال‌های اخیر به طور کامل با رشد تولید و درآمد ملی کشور متناسب نبوده و روندی کاهنده داشته است. با توجه به اینکه در سال‌های مورد نظر، تورم و شرایط کلان اقتصاد کشور از وضعیت بهتر و با ثبات‌تری در مقایسه با برنامه دوم برخوردار بوده است، عدم ثبات شرایط سیاسی و خارجی ناشی از موضوع انرژی هسته‌ای می‌تواند در بروز این وضعیت مؤثر باشد.

شایان ذکر است که در طول برنامه اول و سال‌های ابتدای برنامه دوم، درآمد ملی سرانه روند صعودی ملایمی داشته است. اما، روند پس‌انداز ملی نسبتاً پرشتاب بوده که ناشی از انتظارات تورمی افراد جامعه و پیش‌بینی افزایش قیمت دارایی‌ها در سال‌های بعد بوده است.





۱۱- تشکیل سرمایه ثابت ناخالص داخلی

تشکیل سرمایه ثابت ناخالص داخلی و رشد سرمایه‌گذاری از عوامل اصلی و موثر تولید و درآمد ملی به شمار می‌آید. به گونه‌ای که افزایش سرمایه‌گذاری در هر دوره منجر به تداوم رشد تولید و درآمد در سال‌های پس از آن خواهد شد.

تشکیل سرمایه ثابت ناخالص داخلی به قیمت‌های ثابت سال ۱۳۷۶ در سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ از روندی صعودی برخوردار بوده و به طور متوسط حدود ۶/۹ درصد در سال رشد داشته، ولی پرنوسان بوده است. رشد این متغیر در سال‌های پایانی برنامه اول و ابتدای برنامه دوم، روندی نزولی داشته و حتی با رشد منفی نیز مواجه شده است.

عدم اطمینان‌های ناشی از چرخش سیاستی از تعدیل به تثبیت اقتصادی، نوسانات نرخ ارز و بروز بحران بدهی‌های ارزی، انتظارات تورمی و سوق یافتن بخشی از پس‌اندازهای محدود جامعه به سمت بازارهای غیر تولیدی نظیر بازار ارز، سکه و طلا از عوامل اصلی پایین بودن سطح تشکیل سرمایه جامعه در سال‌های مورد اشاره به شمار می‌آیند.

مشخصه های آماری رشد اجزای تشکیل سرمایه ثابت ناخالص در برنامه های توسعه (۱)

ضریب پراکندگی					میانگین برنامه					عنوان
چهارم	سوم	دوم	اول	کل	چهارم	سوم	دوم	اول	کل	
۰،۲۹	۰،۴۲	۱،۴۰	۲،۴۰	۱،۹۴	۴،۲	۹،۵	۸،۰	۹،۲	۶،۹	تشکیل سرمایه ثابت ناخالص
۰،۳۹	۰،۵۱	۱،۲۶	۴،۳۴	۲،۴۳	۴،۱	۱۲،۲	۱۵،۴	۸،۵	۹،۱	ماشین آلات
۰،۱۴	۱،۲۴	۶،۰۲	۱،۰۹	۲،۰۱	۴،۳	۵،۶	۱،۴	۹،۷	۴،۵	ساختمان
۰،۰۳	۰،۳۱	۱،۳۳	۲۶،۳۳	۳،۱۴	۴،۱	۱۲،۳	۱۳،۷	۱،۴	۶،۸	بخش خصوصی
۱،۰۲	۱،۸۸	۹،۲۶	۱،۰۵	۲،۴۰	۴،۴	۴،۱	۱،۲	۲۲،۷	۷،۲	بخش دولتی
NA	۴،۳۳	۳،۰۶	۲،۳۳	۳،۶۰	NA	۳،۳	۱۲،۰	۱۰،۳	۷،۱	کشاورزی
NA	-۲،۱۸	۲،۰۸	۸،۲۴	۵،۷۱	NA	-۱۳،۹	۲۲،۴	۷،۵	۸،۳	نفت و گاز
NA	۰،۵۱	۱،۹۸	۲،۰۹	۲،۵۷	NA	۱۴،۸	۴،۹	۱۵،۲	۸،۳	صنایع و معادن
NA	۰،۵۷	۱،۴۰	۳،۱۳	۲،۳۹	NA	۱۷،۲	۱۶،۴	۱۳،۰	۱۱،۷	صنعت و معدن
NA	۱،۸۰	-۱،۴۸	۱،۴۱	۸،۲۰	NA	۶،۲	-۸،۷	۱۸،۴	۲،۶	آب و برق و گاز
NA	۱،۵۹	۱۳،۴۸	۱۶،۵۸	۱۴،۶۲	NA	۲۶،۷	۳،۶	۶،۲	۴،۶	ساختمان
NA	۰،۴۴	۱،۵۶	۲،۸۰	۱،۹۳	NA	۸،۸	۷،۶	۶،۹	۶،۹	خدمات
NA	۰،۶۷	۱،۳۹	۳،۵۶	۱،۸۰	NA	۱۵،۶	۱۴،۰	۹،۸	۱۲،۷	حمل و نقل
NA	۳،۵۶	۲،۱۳	۶،۳۲	۳،۵۴	NA	۱۰،۲	۳۲،۰	۹،۵	۱۵،۳	ارتباطات
NA	۰،۵۶	۶،۹۵	۲۰،۹۶	۵،۳۵	NA	۷،۴	۰،۸	۰،۸	۲،۱	مستغلات
NA	۱،۵۳	۲،۲۴	۱،۶۰	۲،۱۵	NA	۵،۱	۷،۷	۱۱،۴	۷،۱	سایر

۱- ارقام تشکیل سرمایه در بخش های دولتی و خصوصی در سال های ۸۵-۱۳۸۳ برآوردی است و دوره قسمت زرد رنگ ۸۲-۱۳۶۸ می باشد.

مقایسه وضعیت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تفکیک ماشین‌آلات و ساختمان و همچنین به تفکیک دولتی و خصوصی نشان می‌دهد که کاهش مذکور عمدتاً ناشی از کاهش رشد تشکیل سرمایه در بخش ماشین‌آلات و سرمایه‌گذاری بخش خصوصی به ویژه در سال پایانی برنامه اول توسعه بوده است. در ۲ سال اول برنامه دوم توسعه، کاهش رشد تشکیل سرمایه به بخش ساختمان و بخش دولتی نیز تسری یافته و سبب شده تا تشکیل سرمایه ثابت ناخالص کل با افت بیشتری مواجه شود.

بررسی اجزای تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تفکیک بخش‌های اقتصادی نیز حاکی از آن است که در میان بخش‌های مزبور، تشکیل سرمایه در بخش‌های کشاورزی و صنایع و معادن طی سال‌های برنامه اول از رشد نسبتاً خوبی برخوردار بوده است. لیکن در برنامه دوم، میزان رشد در بخش صنایع و معادن با افت بسیار شدید مواجه شده و در برخی سال‌ها منفی بوده است. به گونه‌ای که رشد متوسط سالانه آن در این دوره، کمترین مقدار طی برنامه‌های توسعه می‌باشد. کاهش تشکیل سرمایه در بخش صنایع و معادن، عمدتاً ناشی از کاهش شدید سرمایه‌گذاری در بخش‌های آب و برق و گاز و ساختمان بوده است.

سهم زیر بخش‌های تشکیل سرمایه ثابت ناخالص

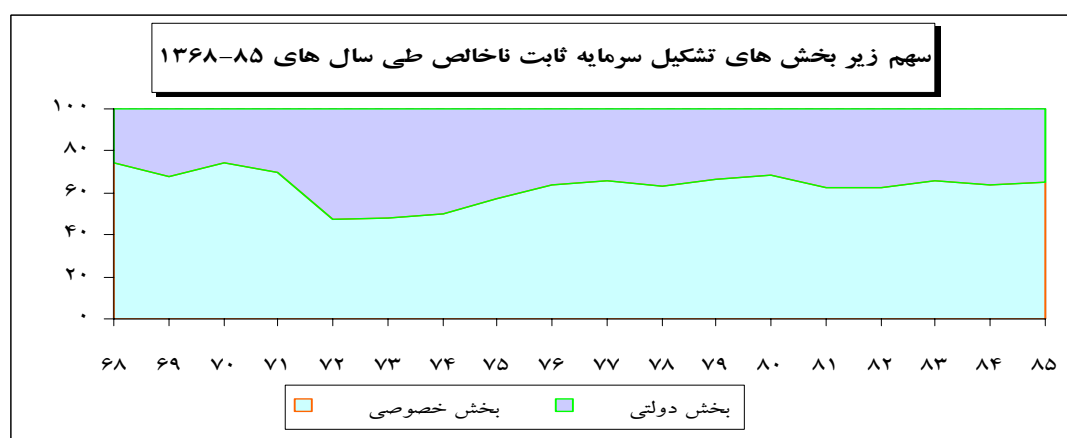
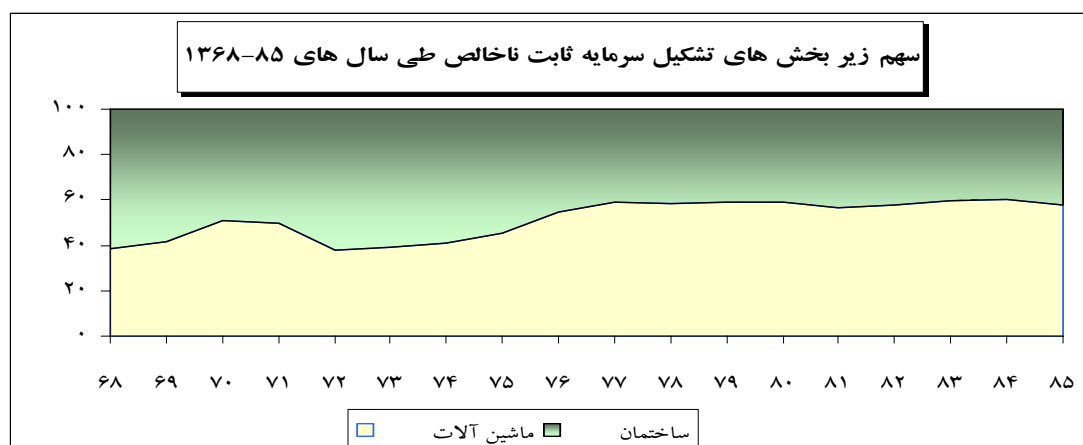
درصد

عنوان	کل دوره	متوسط برنامه		
		اول	دوم	چهارم
تشکیل سرمایه ثابت ناخالص	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰
ماشین‌آلات	۵۱،۵	۴۳،۷	۵۱،۸	۵۸،۸
ساختمان	۴۸،۵	۵۶،۳	۴۸،۲	۴۱،۲
بخش خصوصی	۶۳،۱	۶۶،۷	۶۰،۱	۶۴،۲
بخش دولتی	۳۶،۹	۳۳،۳	۳۹،۹	۳۵،۸
کشاورزی	۴،۵	۴،۹	۴،۳	NA
نفت و گاز	۵،۱	۲،۶	۶،۲	NA
صنایع و معادن	۲۵،۰	۲۴،۷	۲۳،۹	NA
صنعت و معدن	۱۴،۳	۱۱،۷	۱۳،۲	NA
آب و برق و گاز	۹،۴	۱۱،۲	۹،۸	NA
ساختمان	۱،۲	۱،۹	۰،۹	NA
خدمات	۶۵،۴	۶۷،۸	۶۵،۶	NA
حمل و نقل	۱۳،۳	۱۰،۹	۱۳،۳	NA
ارتباطات	۲،۲	۱،۳	۲،۶	NA
مستغلات	۲۰،۹	۲۷،۶	۱۸،۰	NA
سایر	۲۸،۹	۲۷،۹	۳۱،۷	NA

× ارقام تشکیل سرمایه در بخش‌های دولتی و خصوصی در سال‌های ۸۵-۱۳۸۳ برآوردی است و دوره قسمت زرد رنگ ۸۲-۱۳۶۸ می‌باشد.

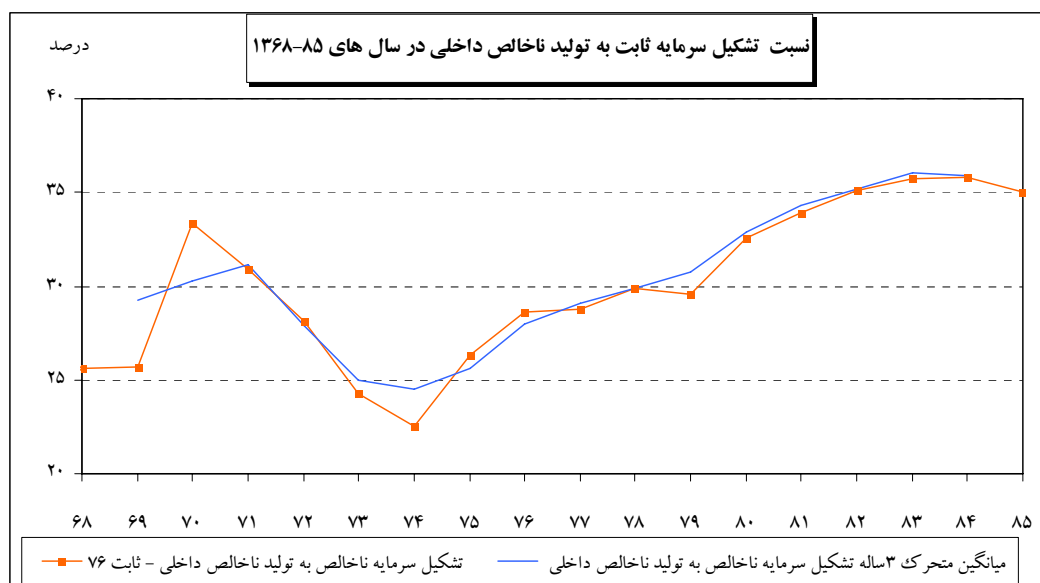
طی سال‌های برنامه سوم توسعه با بهبود اوضاع اقتصادی، اصلاح قانون مالیات‌ها و ایجاد حساب ذخیره ارزی و همچنین بهبود نسبی شرایط سیاسی، رشد متوسط تشکیل سرمایه در زیربخش‌های صنایع و معادن و خدمات بهبود یافته و با کاهش نوسانات آن، تشکیل سرمایه کل نیز تا حدودی روند باثباتی یافته است. لیکن رشد تشکیل سرمایه در بخش کشاورزی به کمترین مقدار خود رسیده و رشد بخش نفت و گاز نیز منفی بوده است.

بروز پدیده خشکسالی در بخش‌های زیادی از کشور، ساختار سنتی، عدم انجام مکانیزاسیون به شکل پیشرفته و فراهم نبودن شرایط ایجاد کشاورزی صنعتی که منجر به کاهش بازدهی و عدم تمایل سرمایه‌گذاران به انجام فعالیتهای کشاورزی شود، دلیل اصلی افت رشد تشکیل سرمایه در بخش کشاورزی به شمار می‌آید.



نسبت تشکیل سرمایه ثابت به تولید ناخالص داخلی نشان می‌دهد که در سال‌های ابتدای برنامه اول توسعه، نسبت مزبور از رشد نسبتاً خوبی برخوردار بوده و در بیشترین مقدار خود در طول دوره مورد بررسی قرار گرفته است. بی‌ثباتی‌های ناشی از چرخش سیاستی و سایر تحولات اقتصادی موجب گردیده تا در برنامه دوم این نسبت با افت بسیار شدید مواجه شود. با وجود این، در برنامه‌های سوم و چهارم روندی صعودی با شیب کاهنده داشته است.

در مجموع می‌توان گفت که نسبت تشکیل سرمایه به تولید ناخالص در ایران در مقایسه با کشورهای منطقه نسبتاً بالاست. به گونه‌ای که رقم مزبور در ایران ۱/۲ برابر بیشتر از میانگین این نسبت در میان ۲۰ کشور منطقه مورد بررسی است. لیکن، مقایسه روند این نسبت با ارقام رشد واقعی کشور بیانگر پایین بودن بهره‌وری سرمایه‌گذاری در ایران می‌باشد.

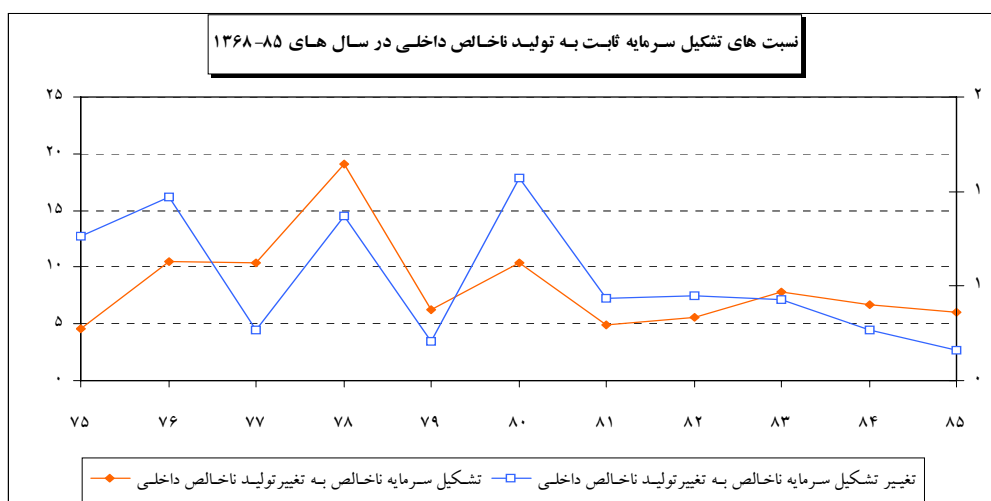


نسبت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تغییر تولید ناخالص داخلی (ICOR)^۱ و همچنین، نسبت تغییر تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به تغییر تولید ناخالص داخلی که از نسبت‌های مهم در بررسی تشکیل سرمایه

۱- Incremental Capital Output Ratio (ICOR)

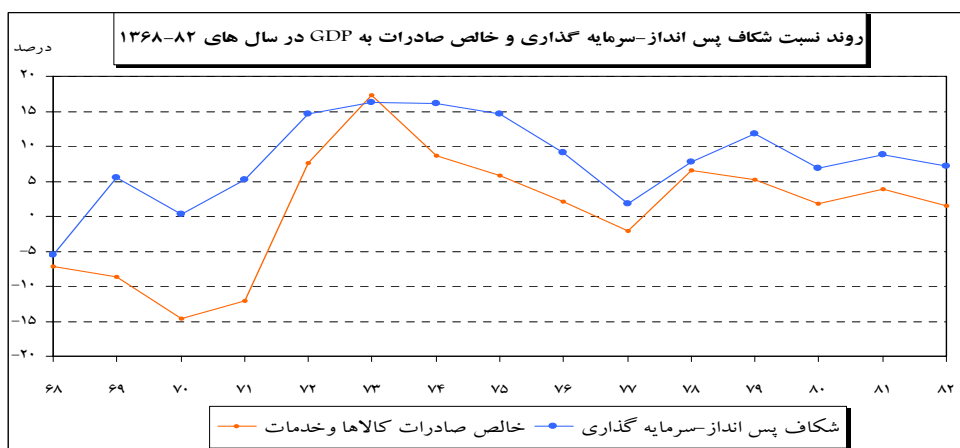
می‌باشند نیز حاکی از آن است که از برنامه سوم توسعه از نوسان شدید این نسبت‌ها کاسته شده و روندی باثبات‌تر داشته‌اند. کاهش نوسان و ثبات نسبی نسبت‌های مزبور از آن جهت حائز اهمیت است که در ثبات برنامه‌ریزی اقتصادی مؤثر بوده و از جهت نحوه تصمیم‌گیری سرمایه‌گذاران بسیار مهم می‌باشند.

علی‌رغم این، نسبت تشکیل سرمایه ثابت به تغییر تولید ناخالص داخلی در سال‌های اخیر کاهش یافته عمدتاً به دلیل کاهش میزان تشکیل سرمایه ثابت بوده و افزایش ریسک‌های اقتصادی ناشی از مسائل مربوط به موضوع انرژی هسته‌ای از عوامل اصلی آن به شمار می‌آید.



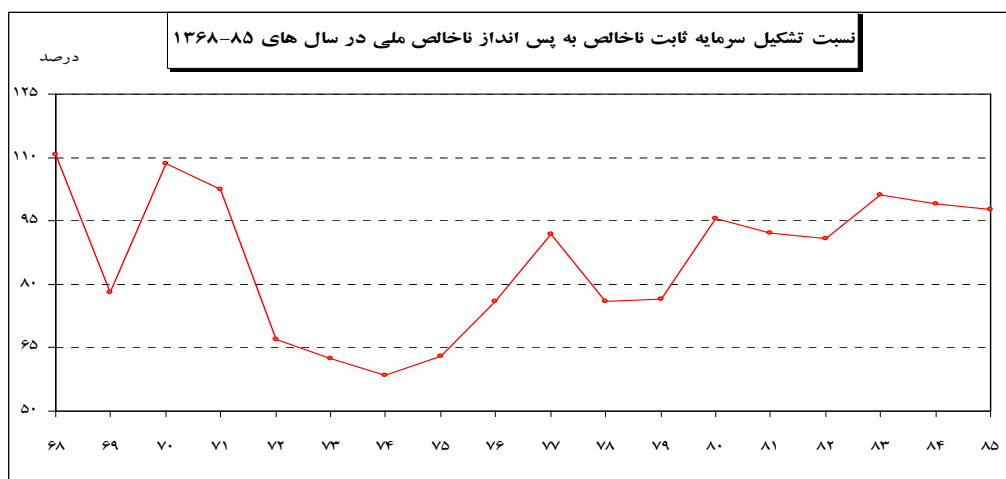
۱۲- شکاف پس‌انداز - سرمایه‌گذاری

شکاف پس‌انداز - سرمایه‌گذاری از متغیرهای اساسی در اقتصاد می‌باشد که نحوه تامین مالی و میزان تبدیل پس‌اندازهای جامعه به سرمایه‌گذاری‌های انجام شده در کشور را نشان می‌دهد. مقایسه نسبت شکاف پس‌انداز - سرمایه‌گذاری و خالص صادرات و واردات کالاها و خدمات به GDP در سال‌های ۱۳۶۸-۸۲ نشان می‌دهد که این دو متغیر (بجز سال ۱۳۷۳) روندی کاملاً همسو داشته‌اند که این روند از منظر اقتصادی منطقی بوده و مطابق با روند مورد انتظار می‌باشد.



بررسی نسبت تشکیل سرمایه ثابت ناخالص به پس انداز ناخالص ملی نیز نشان می‌دهد که در طول دوره مورد مطالعه، این نسبت به طور متوسط حدود ۸۶ درصد بوده است. به عبارت دیگر، بخشی از پس انداز مازاد بر تشکیل سرمایه ناخالص که حاصل فعل و انفعال داخلی اقتصاد کشور با دنیای خارج می‌باشد به شکل خروج سرمایه یا ورود کالا نمود یافته است. در سال‌های برنامه دوم، نسبت مزبور در کمترین مقدار خود (حدود ۷۳ درصد) قرار داشته که عمدتاً به دلیل سیاست ناموفق تک نرخی نمودن ارز و بحران بدهی‌ها و شرایط نامناسب اقتصادی ناشی از سیاست تعدیل اقتصادی بود.

بنابراین، گرچه نسبت پس انداز به تولید و درآمد مهم است، ترکیب و نحوه سرمایه‌گذاری پس اندازهای حاصله و هدایت آن به سمت فعالیت‌های مولد و تولیدی نیز اهمیت فوق‌العاده دارد که با تقویت موسسات مالی نظیر بورس اوراق بهادار و تعمیق آن و همچنین بانکهای سرمایه‌گذاری می‌توان به این هدف نائل گردید.

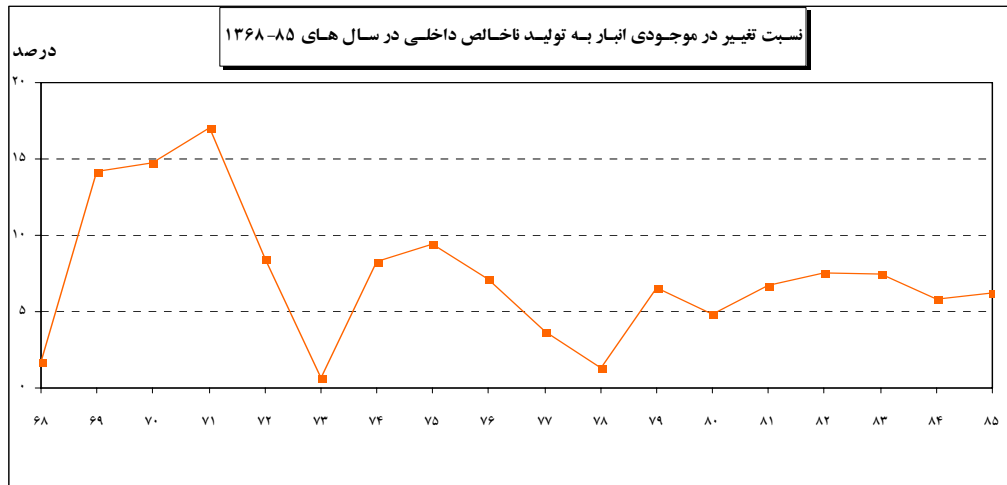


۱۳- وضعیت موجودی انبار

نسبت تغییر در موجودی انبار به هزینه ناخالص داخلی در طول دوره مورد بررسی در حدود ۷/۳ درصد بوده که در مقایسه با میزان آن برای کشورهای در حال توسعه که بین ۲ تا ۳ درصد می‌باشد، رقم بالایی است.

گرچه نگهداری بخشی از تولید جهت مقابله با نوسانات عرضه و تقاضا ضروری است، لیکن نسبت بالای موجودی انبار، بیانگر فقدان سیستم‌های مدرن در زمینه تولید و روش‌های جدید انبارداری مبتنی بر حداقل نمودن هزینه و به عبارتی تداوم استفاده از مکانیزم‌های تولید و عرضه سنتی است.

در سال‌های آغاز برنامه‌های دوم و سوم توسعه به دلیل تورم شدید، مزاد تقاضای بازار و عدم تکافوی واردات جهت تامین عرضه، موجودی انبار به حداقل مقدار خود در سال‌های مورد بررسی رسید، لیکن به دلیل عدم بکارگیری سیستم‌های جدید انبارداری و همچنین، انتظارات تورمی در سال‌های اخیر، نسبت مذکور بالا مانده است.



۱۴- صادرات و واردات (تجارت برون مرزی)

۱۴-۱- وضعیت صادرات غیرنفتی

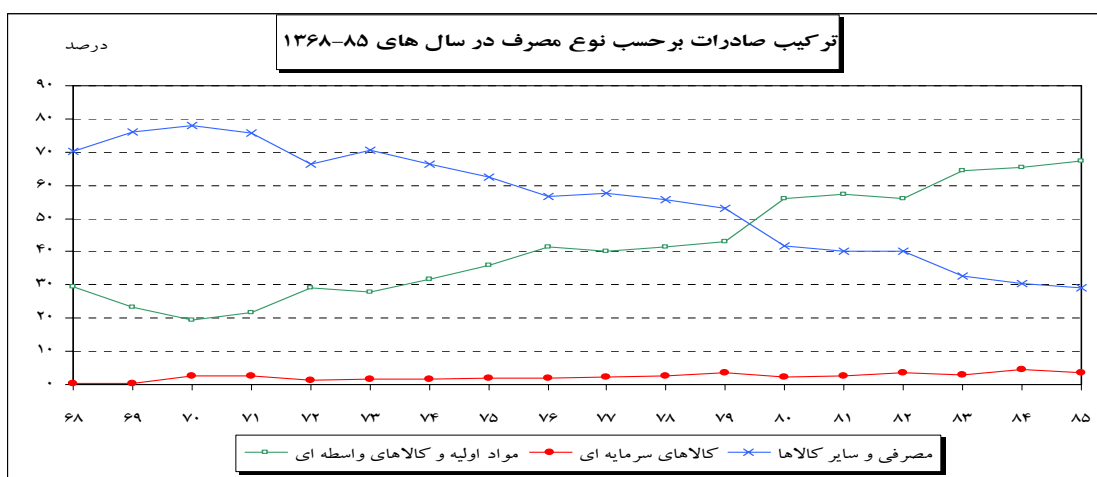
علی‌رغم توجه به صادرات غیرنفتی در برنامه‌های توسعه و اتخاذ سیاست‌های تشویقی، نسبت خالص صادرات کالاها و خدمات به تولید ناخالص در طول دوره حدود ۲ درصد بوده است. نسبت مزبور از منفی ۷ درصد در برنامه اول به حدود ۸ درصد افزایش یافته و بیانگر بهبود نسبی آن است، لیکن رشد صادرات نفت و گاز عامل اصلی این افزایش بوده و نسبت متوسط صادرات غیرنفتی به GDP در طول دوره از حدود ۶ درصد فراتر نرفته است.

ترکیب صادرات غیرنفتی کشور نشان می‌دهد که کالاهای سنتی و کشاورزی بیش از ۵۰ درصد و کالاهای صنعتی حدود ۴۸ درصد از کل صادرات غیر نفتی گمرکی در سال‌های ۸۵-۱۳۶۸ را تشکیل داده است. سهم‌های مزبور در برنامه اول به ترتیب حدود ۷۴ و ۲۴ درصد بوده که در برنامه چهارم به ترتیب به ۲۴ و ۷۴ درصد تغییر یافته است. با وجود اینکه ارزش صادراتی کالاهای سنتی و کشاورزی طی سال‌های اخیر رشد خوبی داشته است، لیکن سهم کالاهای مزبور از کل صادرات غیرنفتی و همچنین ارزش افزوده بخش کشاورزی روندی کاهنده داشته و در مقابل بر سهم صادرات کالاهای صنعتی از کل صادرات و همچنین سهم آن از ارزش افزوده این بخش افزوده شده است.

سهم صادرات گمرکی براساس نوع مصرف

متوسط برنامه (درصد)					عنوان
کل	چهارم	سوم	دوم	اول	
۱۰۰،۰۰	۱۰۰،۰۰	۱۰۰،۰۰	۱۰۰،۰۰	۱۰۰،۰۰	جمع صادرات گمرکی
۵۰،۴۵	۲۳،۷	۳۵،۳	۵۳،۹	۷۴،۴	کالاهای سنتی و کشاورزی
۱،۵	۲،۰	۱،۱	۱،۴	۱،۷	کلوخه‌های کانی و فلزی
۴۸،۲	۷۳،۸	۶۳،۵	۴۴،۷	۲۳،۹	کالاهای صنعتی
۴۱،۷	۶۶،۳	۵۵،۴	۳۵،۴	۲۴،۶	مواد اولیه و کالاهای واسطه‌ای
۳۶،۲	۵۲،۹	۴۴،۵	۳۳،۳	۲۴،۱	صنعت و معدن
۰،۶	۰،۳	۰،۴	۰،۸	N A	کشاورزی
۵،۲	۱۳،۱	۱۰،۴	۱،۳	۰،۹	خدمات
۲،۴	۴،۰	۳،۱	۱،۹	۱،۴	کالاهای سرمایه‌ای
۵۵،۷	۲۹،۷	۴۱،۶	۶۲،۷	۷۳،۳	مصرفی و سایر کالاها

افزایش فوق العاده سهم کالاهای صنعتی صادر شده بیانگر رشد بالاتر صادرات محصولات این گروه در مقایسه با محصولات کشاورزی و توجه بیشتر متولیان و صادرکنندگان کشور به صدور محصولات صنعتی در مقایسه با محصولات سنتی و فراوری نشده می‌باشد. بخشی از رشد ارزش صادرات کالاهای صنعتی به دلیل بهره‌برداری از سرمایه‌گذاری‌های انجام شده در حوزه نفت و گاز پارس جنوبی و افزایش مقدار محصولات پتروشیمی بوده و توجه ویژه به بخش صنعت و حمایت‌های صورت گرفته از تولید و صادرات محصولات صنعتی نیز بر آن موثر بوده است. اما باید در نظر داشت که افزایش قیمت فرآورده‌های نفتی، آهن‌آلات و محصولات فولادی که به واسطه افزایش قیمت‌های جهانی ایجاد شده نیز در این میان نقش زیادی دارد.



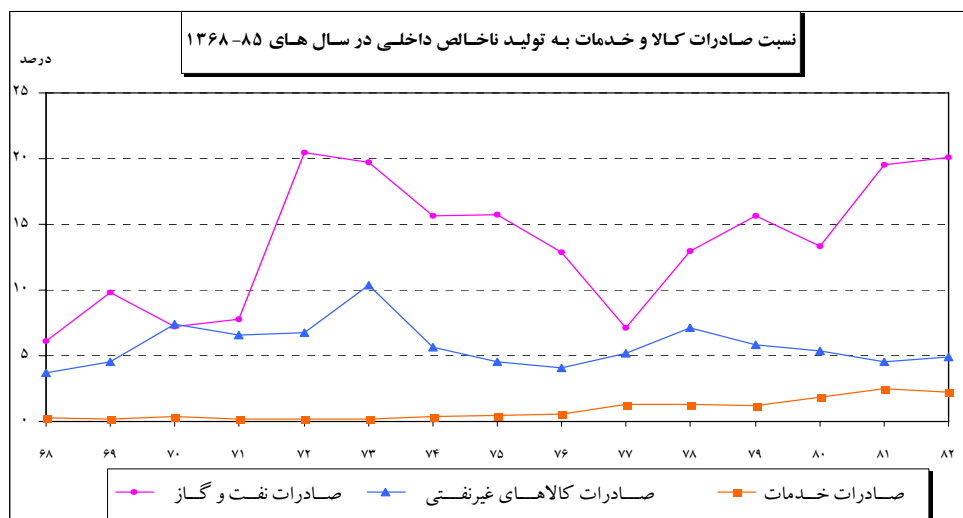
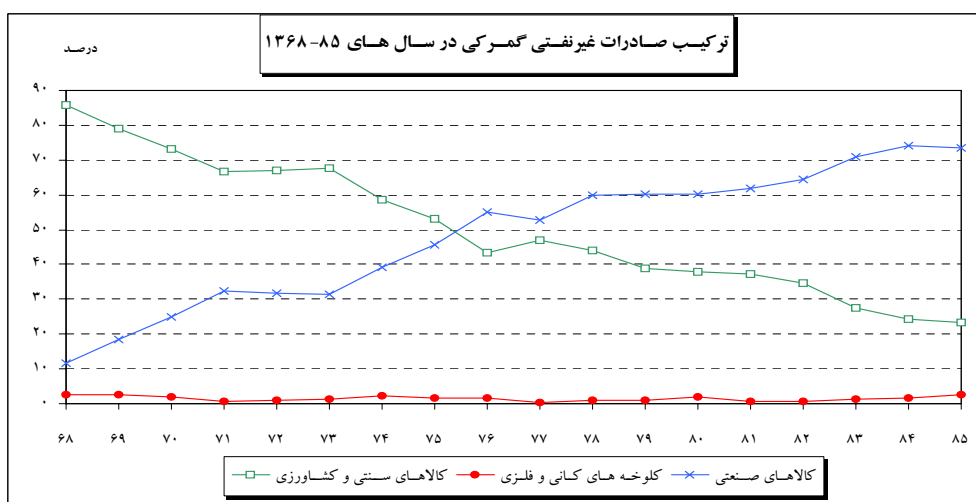
علی‌رغم اینکه متوسط سهم کالاهای صادراتی مصرفی از کل صادرات در طول دوره از سهم صادرات مواد اولیه و واسطه‌ای بیشتر بوده، لیکن روند صادرات مواد اولیه و واسطه‌ای صعودی بوده و از حدود ۲۵ درصد در برنامه اول به حدود ۶۶ درصد در سال‌های ابتدای برنامه چهارم رسیده که بخشی از آن می‌تواند به دلیل تمایل شرکای تجاری به خرید مواد اولیه و واسطه‌ای و سهولت صادرات آن باشد. اما به نظر می‌رسد قدرت رقابت پایین محصولات نهایی و مصرفی نیز در این امر موثر است.

کاهش نسبت صادرات غیرنفتی به GDP در سال‌های ابتدای برنامه دوم عمدتاً به دلیل افزایش شدید انتظارات تورمی ناشی از سیاست‌های تعدیل اقتصادی و تامین تقاضای داخلی بوده است. با کاهش شدید درآمدهای نفتی در سال ۱۳۷۷ سهم صادرات غیر نفتی بهبود یافته و روندی صعودی داشته و با افزایش مجدد قیمت جهانی نفت و روند صعودی درآمدهای نفتی از سهم صادرات غیر نفتی نیز کاسته شده است.

درصد

نسبت های مربوط به زیربخش های صادرات

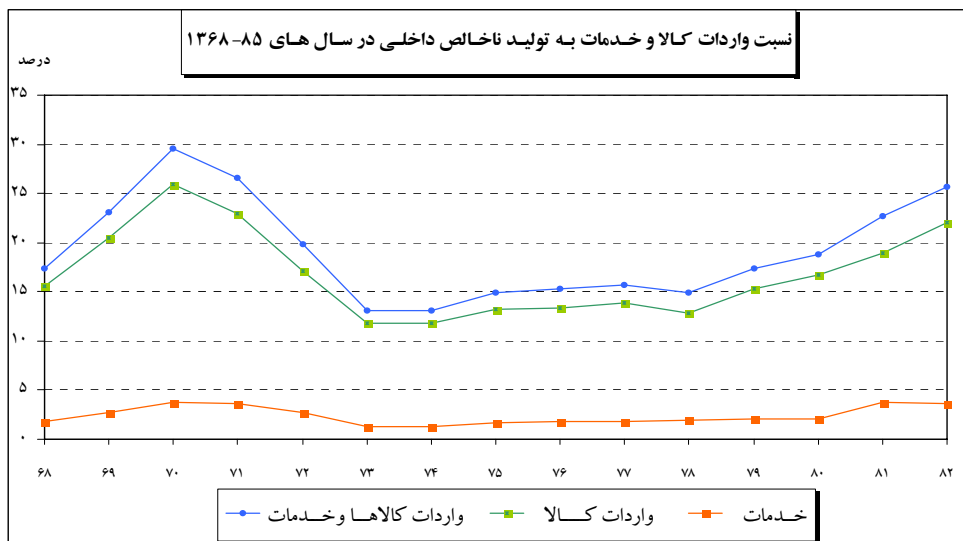
عنوان	کل دوره	متوسط برنامه		
		اول	دوم	چهارم
صادرات کالاهای صنعتی و کلوخه های کانی و فلزی به ارزش افزوده صنعت و معدن	۱۴،۵	۸،۶	۱۳،۸	۲۵،۶
صادرات کالاهای سنتی و کشاورزی به ارزش افزوده گروه کشاورزی	۱۸،۴	۲۳،۴	۱۵،۳	۱۳،۲
صادرات مواد اولیه و واسطه ای صنایع و معادن به ارزش افزوده این بخش	۱۰،۶	۷،۸	۹،۳	۱۷،۹
صادرات مواد اولیه و واسطه ای کشاورزی به ارزش افزوده این بخش	۰،۲	NA	۰،۲	۰،۲
صادرات مواد اولیه و واسطه ای خدمات به ارزش افزوده این بخش	۰،۵	۰،۱	۰،۲	۱،۶
صادرات کالاهای سرمایه ای به ارزش افزوده صنعت و معدن و خدمات	۰،۲	۰،۱	۰،۲	۰،۴
صادرات کالاهای مصرفی به هزینه های مصرفی خصوصی و دولتی	۵،۰	۶،۵	۴،۸	۲،۹



۲-۱۴- وضعیت واردات

بررسی وضعیت واردات کالاها و خدمات در دوره مورد بررسی نشان می‌دهد که رقم واردات کشور از رشد متوسط ۴ درصد در سال برخوردار بوده و روندی پرنوسان داشته است. در برنامه‌های اول و سوم، رشد متوسط واردات از میانگین دوره بسیار بالاتر بوده است. متوسط رشد مزبور در برنامه دوم منفی گردیده است. به کارگیری ظرفیت‌های موجود تولید، ایجاد سرمایه‌گذاری‌های جدید و ظرفیت‌سازی در برنامه اول توسعه که در راستای بازسازی اقتصادی پس از جنگ تحمیلی و تأمین تقاضا صورت گرفت، سبب افزایش چشمگیر واردات به خصوص واردات کالاهای سرمایه‌ای و واسطه‌ای شد. اما به دلیل نوسانات و افزایش نرخ ارز ناشی از انجام سیاست‌های تعدیل اقتصادی، روند رشد واردات کاهش یافته است.

به دلیل چرخش ایجاد شده در سیاست اقتصادی دولت، تثبیت نرخ ارز و محدودیت منابع ارزی در ابتدای برنامه دوم توسعه، واردات از روند باثباتی برخوردار شده و ترکیب آن نیز در راستای کاهش واردات کالاهای واسطه‌ای و افزایش کالاهای سرمایه‌ای تغییر یافته است. به عبارت دیگر با اتخاذ سیاست‌های تثبیت اقتصادی در این دوره، واردات به سمت تامین ماشین‌آلات و سایر ابزارهای سرمایه‌ای که به تشکیل سرمایه منجر می‌گردد، سوق یافته و ترکیب نسبتاً مناسبی داشته است.



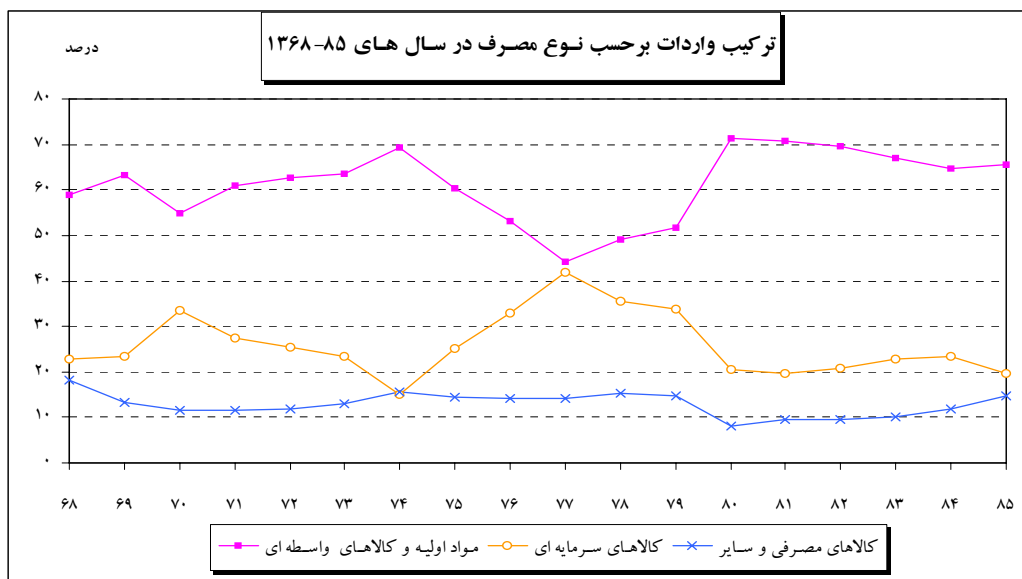
سهم واردات گمرکی براساس نوع مصرف

عنوان	متوسط هر برنامه (درصد)			
	اول	دوم	سوم	چهارم
واردات غیرنفتی گمرکی	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰	۱۰۰،۰
مواد اولیه و کالاهای واسطه ای	۶۰،۲	۵۸،۰	۶۶،۱	۶۵،۱
صنعت و معدن	۴۵،۸	۴۵،۰	۵۲،۳	۴۹،۲
ساختمان	۴،۳	۳،۹	۲،۷	۳،۷
کشاورزی	۶،۸	۲،۴	۲،۷	۲،۶
خدمات	۲،۱	۱،۲	۷،۸	۹،۱
کالاهای سرمایه ای	۲۶،۵	۲۷،۷	۲۳،۶	۲۱،۶
کالاهای مصرفی و سایر	۱۳،۴	۱۴،۳	۱۰،۴	۱۳،۲

در برنامه سوم توسعه، ثبات نرخ ارز اسمی و تداوم آن از یکسو و روند نزولی نرخ تورم و شکل گیری انتظارات کاهنده سطح قیمت‌ها از سوی دیگر سبب شده تا نرخ ارز واقعی کاهش یابد. همچنین، افزایش درآمدهای ارزی حاصل از صادرات نفت و گاز و تداوم آن موجب افزایش چشمگیر واردات طی سال‌های برنامه مذکور گردیده و در سال‌های اخیر نیز تداوم یافته است.

علی‌رغم اینکه رشد واردات کالاهای مصرفی در برنامه سوم (بجز سال ۱۳۸۰) روندی صعودی داشته و متوسط آن در حد برنامه دوم حفظ شده است، لیکن واردات مواد اولیه و واسطه‌ای در این دوره بسیار فراتر از برنامه دوم بوده و سهم آن نیز بیشتر شده است. وضعیت مزبور در ۲ سال اول برنامه چهارم توسعه به مراتب وخیم‌تر شده و رشد واردات کالاهای سرمایه‌ای و سهم آن از واردات کل کاهش زیادی یافته است. شایان ذکر است که در طول دوره مورد بررسی، نسبت واردات کالاهای سرمایه‌ای به تشکیل سرمایه حدود ۱۳ درصد بوده و این رقم در برنامه‌های دوم و سوم بسیار پایین‌تر بوده است.

افزایش درآمدهای ارزی حاصل از صادرات نفت که از بهبود وضعیت جهانی قیمت نفت ناشی گردید و تثبیت نرخ ارز از دلایل اصلی افزایش واردات به شمار می‌آید. لیکن، افزایش چشمگیر واردات مواد اولیه و واسطه‌ای می‌تواند ناشی از اعمال تحریم‌های اقتصادی و تمایل تولیدکنندگان به نگهداری مقادیر بالاتر مواد اولیه جهت تداوم تولید در راستای تامین تقاضای داخلی و جلوگیری از توقف تولید (به واسطه بدتر شدن شرایط اقتصادی ناشی از تحریم‌های اقتصادی) بیشتر باشد.



به عبارت دیگر، نگرانی ناشی از تحریم‌های اقتصادی کشور سبب دپوی مواد اولیه و واسطه‌ای در میان تولیدکنندگان گردیده و با توجه به کاهش سهم واردات کالاهای سرمایه‌ای، عملاً ظرفیت‌سازی در اقتصاد شکل نگرفته است. لذا در این دوره، افزایش واردات منجر به تشکیل سرمایه بیشتر در کشور نشده است. رشد پایین تشکیل سرمایه ثابت ناخالص داخلی و نسبت بالای تغییر در موجودی انبار به GDP در سال‌های اخیر مویذ این نکته می‌باشد.

نسبت های مربوط به زیربخش های واردات

متوسط برنامه				کل دوره	عنوان
چهارم	سوم	دوم	اول		
۶۲٫۲	۵۵٫۳	۳۲٫۸	۶۲٫۳	۵۱٫۴	واردات مواد اولیه و واسطه ای صنایع و معادن به ارزش افزوده این بخش
۴٫۹	۴٫۱	۱٫۸	۸٫۳	۴٫۵	واردات مواد اولیه و واسطه ای کشاورزی به ارزش افزوده این بخش
۳٫۷	۳٫۰	۰٫۳	۰٫۸	۱٫۹	واردات مواد اولیه و واسطه ای خدمات به ارزش افزوده این بخش
۶٫۷	۶٫۳	۵٫۵	۸٫۹	۶٫۷	واردات کالاهای سرمایه ای به ارزش افزوده صنعت و معدن و خدمات
۴٫۴	۳٫۲	۳٫۰	۴٫۳	۳٫۵	واردات کالاهای مصرفی به هزینه های مصرفی خصوصی و دولتی

۳-۱۴- رابطه مبادله

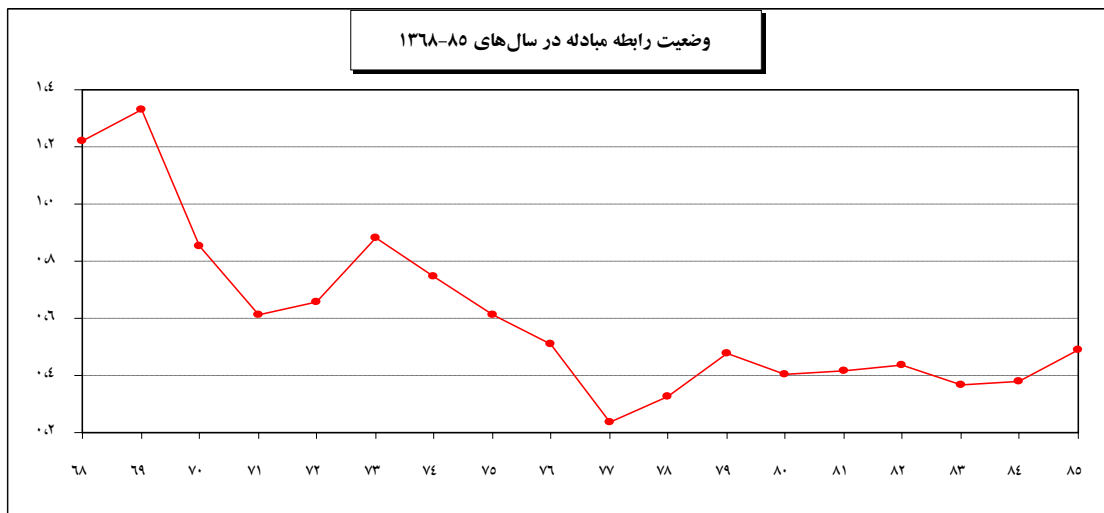
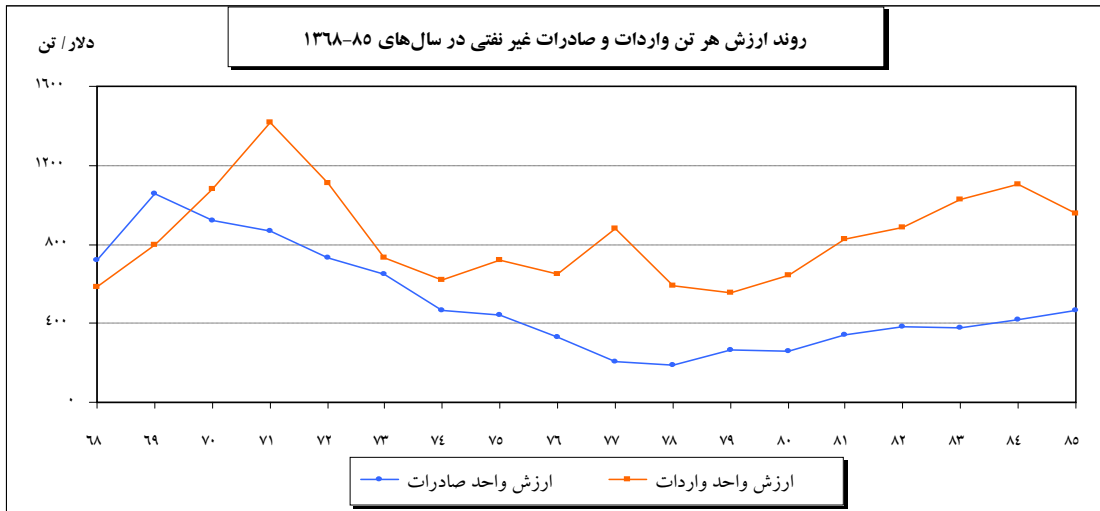
رابطه مبادله و تغییرات آن یکی از متغیرهای مهم در اغلب کشورها به خصوص کشورهای در حال توسعه می‌باشد. درحقیقت رابطه مبادله نشان‌دهنده قدرت خرید کالاهای صادراتی کشور و تخریب آن نشان‌دهنده بدتر شدن وضعیت کشور در بازارهای جهانی می‌باشد.

در طول دوره مورد بررسی، ارزش میانگین هر تن کالای صادراتی ایران حدود ۵۰۶ دلار به ازای هر تن بوده اما با یک روند کاهنده مواجه شده است. به گونه‌ای که از رقم ۸۵۹ دلار بر تن به حدود ۴۴۴ دلار بر تن رسیده که بیانگر کاهش ارزش کالاهای صادراتی می‌باشد. در مقابل، ارزش هر تن کالای وارداتی در دوره مورد بررسی حدود ۸۴۳ دلار به ازای هر تن بوده است. گرچه روند آن تا برنامه سوم کاهنده بوده، لیکن با یک روند افزایشی شدید در سال‌های اخیر مواجه شده است. افزایش قیمت کالاهای خارجی ناشی از افزایش قیمت نفت و تورم جهانی دلیل آن بوده است. همچنین، مشکلات ناشی از تحریم‌های اخیر بین‌المللی علیه ایران نیز می‌تواند در شدت میزان افزایش آن موثر باشد.

روند کاهش بیشتر ارزش هر تن کالای صادراتی در مقابل کالای وارداتی سبب گردیده تا رابطه مبادله در طول دوره مورد بررسی کاهنده شده و به زیان ایران در مبادلات بین‌المللی منجر گردد.

ارزش هر تن کالای صادراتی و وارداتی غیرنفتی گمرکی

عنوان	کل دوره	متوسط سهم هر برنامه		
		اول	دوم	سوم
ارزش واحد صادرات	۵۰۶	۸۵۹	۴۱۹	۳۲۷
ارزش واحد واردات	۸۴۳	۹۹۷	۷۲۱	۷۸۶
رابطه مبادله	۰،۶	۰،۹	۰،۶	۰،۴

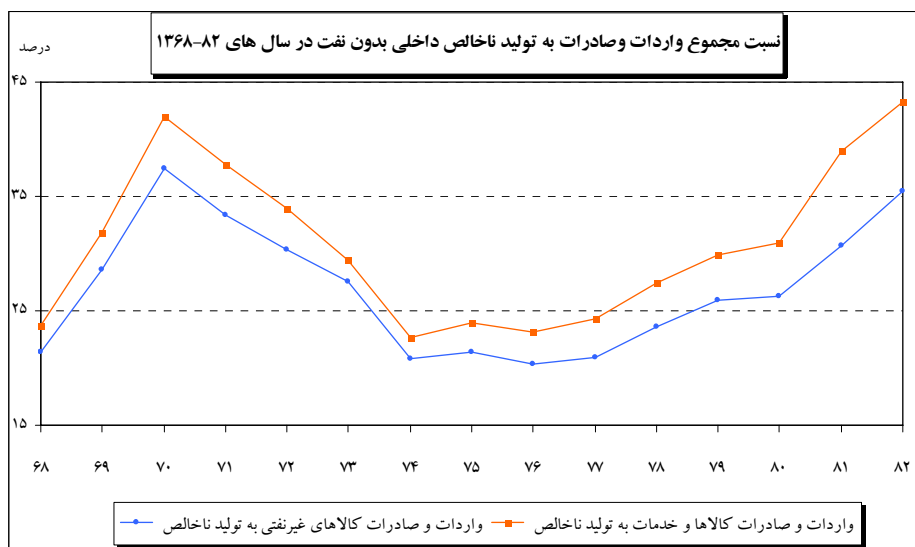


۱۵- نسبت باز بودن اقتصاد

نسبت باز بودن اقتصاد از شاخص‌هایی است که بیانگر میزان ارتباط و مبادلات اقتصادی یک کشور با سایر کشورها می‌باشد. به عبارت دیگر، کشورهایی که این نسبت در آنها بزرگتر است، دارای بیشترین روابط تجاری و اقتصادی با سایر کشورها می‌باشند.

نسبت مجموع واردات و صادرات کالاها و خدمات (غیر از نفت) به تولید ناخالص داخلی بدون نفت که به عنوان معیاری برای تعیین میزان باز بودن اقتصاد محاسبه گردیده است، طی سال‌های مورد بررسی روندی پرنوسان داشته است. با اتخاذ سیاست تعدیل اقتصادی در برنامه اول توسعه، نسبت مزبور ابتدا روند صعودی شتابان داشته است. لیکن با بروز مشکلات اقتصادی و محدودیت‌های ارزی و در نهایت چرخش سیاستی در برنامه دوم، کاهش یافته و در مقادیری کمتر از میزان این نسبت در ابتدای دوره قرار گرفته است. این وضعیت بیانگر بسته‌تر شدن اقتصاد در دوره مزبور است.

در سال‌های پایانی برنامه دوم و در طول برنامه سوم توسعه، روند صعودی این نسبت آغاز شده و تاکنون نیز تداوم داشته است. افزایش این نسبت، عمدتاً از محل افزایش میزان واردات بوده است. زیرا محاسبه نسبت صادرات کالاها و خدمات به تولید ناخالص نشان می‌دهد که در سال‌های اخیر، میزان آن از ۶ درصد فراتر نرفته است. در میان کشورهای منطقه، ایران از نظر شاخص باز بودن اقتصاد در سال ۲۰۰۴ میلادی، رتبه بیستم (با احتساب نفت) را داشته و مقدار این نسبت در ایران ۳۲ درصد کمتر از رقم متوسط منطقه بوده است.



جمع‌بندی و نتیجه‌گیری

بررسی شاخص‌های کلان اقتصادی و مقایسه آن با کشورهای حوزه سند چشم‌انداز، منطقه منا و کشورهای عمده رقیب در منطقه نشان می‌دهد، علی‌رغم اینکه سطح متغیرهای منتخب نظیر تولید ناخالص داخلی، تشکیل سرمایه ثابت و نظایر آن در ایران بالاست، لیکن رشد آنها و وضعیت سرانه متغیرها مناسب نبوده و حاکی از نامطلوب بودن اغلب شاخص‌ها به ویژه رشد اقتصادی، نرخ بیکاری و تورم در ایران می‌باشد.

طی دوره مورد بررسی، متوسط رشد اقتصادی ایران ۵/۲ درصد بوده که در مقایسه با متوسط نرخ رشد کشورهای منطقه پایین می‌باشد و نوسان و بی‌ثباتی بالایی نیز داشته است. در میان برنامه‌های توسعه، بیشترین مقدار رشد در برنامه اول محقق گردیده، لیکن در مقایسه با سایر برنامه‌ها ثبات کمتری داشته است.

در میان زیربخش‌های تولید ناخالص داخلی، گروه صنایع و معادن از بیشترین رشد متوسط برخوردار بوده و در مقایسه با بخش‌های کشاورزی و نفت ضریب پراکندگی کمتری داشت. رشد بخش خدمات نیز بسیار کم‌نوسان و باثبات بوده است. در مقابل، بخش نفت علی‌رغم اینکه کمترین میزان متوسط رشد را در بین بخش‌های اقتصادی داشت به شدت پرنوسان و بی‌ثبات بود.

در مجموع می‌توان گفت، علی‌رغم اینکه متغیرهایی نظیر مصرف (خصوصی و دولتی) از ثبات نسبی برخوردار بوده است، رشد اقتصادی و سرمایه‌گذاری ثبات کمتری داشته‌اند. همچنین، علاوه بر عدم ثبات روندها و نامطلوب بودن روند مصرف و سرمایه‌گذاری، وابستگی زیادی به درآمد نفت و واردات جهت تداوم تولید وجود دارد.

در طول برنامه‌های توسعه از سهم بخش‌های کشاورزی، خدمات و صنایع و معادن کاسته شده و سهم بخش نفت به میزان ۲/۵ برابر افزایش یافته است. تک‌نرخی نمودن ارز در برنامه سوم و افزایش قیمت نفت و فرآورده‌های آن در بازارهای جهانی که از ابتدای برنامه چهارم آغاز گردید از دلایل اصلی افزایش چشمگیر سهم بخش نفت می‌باشد.

در میان بخش‌های تولیدی کشور با توجه به حمایت‌های ارزی و ریالی صورت گرفته از صنایع و معادن (از محل تسهیلات بانکی و حساب ذخیره ارزی OSF) و افزایش میزان تولید، کاهش سهم این بخش در مقایسه با کشاورزی و خدمات کمتر بوده است. لیکن، سهم بخش کشاورزی به دلیل عدم افزایش مناسب تولید و قیمت محصولات آن، همواره روند نزولی داشته است. مشکلاتی نظیر یکپارچه نشدن اراضی، فقدان سیستم‌های آبیاری پیشرفته، عدم حمایت‌های اصولی و کاهش سهم آن از تشکیل سرمایه کل از عوامل اصلی عدم افزایش قابل توجه تولید و سهم بخش کشاورزی بوده است.

در میان اجزای هزینه ناخالص نیز به دلیل کاهش سهم مصرف بخش خصوصی در طول برنامه‌ها از سهم هزینه‌های مصرفی کل کاسته شده است، لیکن سهم مصرف بخش دولتی کماکان بالا مانده است که با توجه به سیاست‌های اتخاذ شده جهت کاهش اندازه دولت، بیانگر عدم موفقیت در واگذاری فعالیت‌ها به بخش غیردولتی (خصوصی‌سازی) و کاهش هزینه‌های مربوطه بوده است.

علی‌رغم اینکه مشکلات ساختاری بخش واقعی و مولد در ایران و همچنین، عدم بهبود تکنولوژی و بهره‌وری در این بخش، عامل اصلی و تاثیرگذار در فرایند رشد می‌باشد، نوسانات و تحولات بخش‌های پولی و ارزی و بی‌انضباطی مالی دولت که عمدتاً ناشی از درآمدهای سرشار و پرنوسان نفت می‌باشد نیز در بی‌ثباتی رشد اقتصادی موثر بوده است.

در سال‌های پایانی برنامه اول و سال‌های پس از ۱۳۸۱ به دلیل فشار تقاضا، عملکرد تولید از میزان بالقوه آن فراتر رفته و شکاف تولید مثبت بوده که به منزله استفاده بالاتر از حد بهینه ظرفیت اقتصاد است. اما در سال‌های ابتدای برنامه دوم به دلیل کاهش فزونی تقاضا، سیکل‌های تولید منفی شده و شرایط نسبتاً رکودی ایجاد شده است.

علاوه بر این، عدم تناسب ظرفیتهای تولید با زیرساخت‌ها و ناهمگونی سرعت آزادسازی متغیرهای کلان با اصلاحات صورت گرفته در بخش قوانین و مقررات و تحولات زیرساختی و نیز فشار تقاضای ناشی از تزریق منابع مالی حاصل از درآمد نفت به اقتصاد از دلایل بالاتر بودن تولید بالفعل از تولید بالقوه بوده است.

با افزایش تولید بالفعل و جذب بخشی از نیروی کار بیکار که با تزریق منابع مالی زیاد و افزایش میزان تشکیل سرمایه به ویژه در بخش صنایع و معادن صورت گرفته، روند بیکاری از سال‌های پایانی برنامه سوم کاهنده شده است. لیکن از آنجا که کاهش مزبور ساختاری نبوده و از محل افزایش تولید بالقوه صورت نگرفته بیکاری در سال‌های اخیر روند افزایشی داشته است.

بنابراین، با توجه به رابطه شکاف بیکاری و شکاف تولید، آنچه می‌بایست به شکل ساختاری کاهش یابد تا اثر پایداری بر رشد اقتصادی داشته باشد، کاهش نرخ بیکاری تعادلی (NAIRU) (نرخ بیکاری در سطح تورم غیرشتابان) است. به عبارت دیگر، چنانچه اصلاحات ساختاری در قوانین کار و دستمزدها و نیز نظام تامین اجتماعی صورت گیرد و نحوه آموزش و بهره‌وری نیروی کار متناسب با ظرفیت تولید و میزان جذب سرمایه در اقتصاد باشد، نرخ بیکاری به شکل پایدار کاهش خواهد یافت.

بررسی ضریب همبستگی زیربخش‌های تولید ناخالص نشان می‌دهد که بیشترین ضریب مربوط به بخش صنایع و معادن با بخش خدمات بوده و کمترین ضریب مربوط به بخش صنایع با کشاورزی می‌باشد. پایین بودن این ضریب می‌تواند ناشی از سنتی بودن و عدم مکانیزاسیون و توسعه کشاورزی صنعتی در کشور باشد. در حالی که بخش نفت با همه بخش‌های اقتصادی از ضریب همبستگی بالایی برخوردار بوده است.

همبستگی پسین و پیشین اجزای تولید نیز حاکی از آن است که میان بخش‌های صنایع و نفت با خدمات و بخش‌های صنعت و نفت یک الگوی مشابه وجود داشته است. به گونه‌ای که نوسانات بخش نفت در دوره‌های قبل، بخشی از تغییرات جاری بخش‌های صنایع و خدمات را تبیین نموده که در بخش صنایع عمدتاً می‌تواند از طریق بخش ساختمان باشد. ضریب همبستگی رشد اقتصادی با رشد درآمدهای نفتی نیز بسیار بالا بوده و اتکای بیش از حد به درآمدهای نفتی از شاخصه‌های اصلی اقتصاد کشور است.

به دلیل ارزان بودن قیمت انرژی در کشور، سرانه مصرف آن برای تولید یک واحد از تولید ناخالص روند افزایشی داشته است. به طوری که شدت انرژی در ایران در مقایسه با کشورهای جهان بسیار بالا بوده و در رتبه دوم قرار دارد. با افزایش قیمت جهانی نفت، وضعیت مزبور وخیم‌تر شده و موجب عدم کارایی و صرفه اقتصادی تولید در برخی صنایع کشور گردیده است.

مقایسه رشد شاخص ضمنی با تورم نشان می‌دهد که شاخص ضمنی از نوسان بیشتری برخوردار بوده که غالباً ناشی از نوسانات قیمت نفت و شاخص قیمت واردات است. این امر مؤید این است که در انجام برنامه‌ریزی‌های اقتصادی، نرخ تورم با ثبات و مناسبتر می‌باشد.

نرخ رشد پس‌انداز در سال‌های اخیر به طور کامل با رشد تولید و درآمد ملی کشور متناسب نبوده و روندی کاهنده داشته است. علاوه بر این، رفتار مصرفی جامعه از ثبات بیشتری نسبت به پس‌انداز ملی برخوردار بوده است. این بدین معنی است که مصرف جامعه به دلیل لختی و اینرسی زیاد با هر تغییر موقت در درآمد ملی به کندی تعدیل می‌شود.

تورم، رشد اقتصادی و درآمد سرانه نامطلوب در عدم شکل‌گیری پس‌انداز جامعه مؤثر می‌باشد. اما مطلوب نبودن وضعیت بورس اوراق بهادار کشور از عوامل اصلی عدم تجهیز مناسب پس‌انداز و تشکیل سرمایه در جامعه محسوب می‌گردد. بنابراین، تعمیق و بهبود بازارهای مالی مطمئن‌ترین راه افزایش پس‌انداز جامعه می‌باشد.

در طول برنامه‌های توسعه تشکیل سرمایه روند رو به رشد داشته، اما در ابتدا به دلیل بی‌ثباتی بوجود آمده در اقتصاد و بحران ارزی و در سال‌های اخیر، عمدتاً به جهت ریسک‌های سرمایه‌گذاری ناشی از مسائل سیاسی و تحریم‌های اقتصادی از روند رشد بلندمدت سرمایه‌گذاری کاسته شده است.

با بهبود اوضاع اقتصادی، اصلاح قانون مالیات‌ها و ایجاد حساب ذخیره ارزی و همچنین بهبود نسبی شرایط سیاسی کشور در سال‌های برنامه سوم توسعه، رشد متوسط تشکیل سرمایه در زیر بخش‌های صنایع و معادن، خدمات و کشاورزی بهبود یافته و با کاهش نوسانات آن، تشکیل سرمایه کل نیز تا حدودی روند باثباتی یافته است.

علی‌رغم اینکه نسبت تشکیل سرمایه به تولید ناخالص در ایران در مقایسه با کشورهای منطقه به نسبت بالا بوده و بیشتر از میانگین این نسبت در میان ۲۰ کشور منطقه مورد بررسی است، مقایسه روند نسبت مزبور با ارقام رشد واقعی، بیانگر پایین بودن بهره‌وری سرمایه‌گذاری در ایران می‌باشد. نسبت مزبور در طول

دوره حدود ۸۶ درصد بوده است. به عبارت دیگر بخشی از پس‌انداز مازاد بر تشکیل سرمایه ناخالص که حاصل فعل و انفعال داخلی اقتصاد کشور با دنیای خارج می‌باشد به شکل خروج سرمایه یا ورود کالا نمود یافته است.

رشد اجزای واردات و صادرات از نوسان زیادی برخوردار بوده و سهم صادرات غیر نفتی از GDP در طول دوره از ۶ درصد فراتر نرفته است. روند کاهشی نسبت مزبور در طول برنامه‌ها بیانگر عدم موفقیت سیاست‌های اتخاذ شده جهت تشویق و توسعه صادرات و رونق بخش‌های تولیدی می‌باشد.

حمایت از بخش صنعت در افزایش ارزش صادرات کالاهای صنعتی موثر بوده، اما رشد آن عمدتاً به دلیل بهره‌برداری از سرمایه‌گذاری‌های انجام شده در حوزه نفت و محصولات پتروشیمی بوده و افزایش قیمت جهانی فرآورده‌های نفتی و محصولات فولادی نیز در این میان نقش زیادی داشته است.

کاهش سهم واردات کالاهای سرمایه‌ای و افزایش مواد اولیه و واسطه‌ای و مصرفی در سال‌های اخیر ناشی از اعمال تحریم‌های اقتصادی و تمایل تولیدکنندگان به نگهداری مقادیر بیشتر مواد اولیه جهت تداوم تولید و تامین تقاضای داخلی بود. رشد پایین تشکیل سرمایه ثابت ناخالص داخلی و نسبت بالای تغییر در موجودی انبار به GDP در سال‌های اخیر مؤید این روند می‌باشد.

روند کاهنده ارزش واحد کالاهای صادراتی در مقابل کالاهای وارداتی، موجب کاهش رابطه مبادله به زیان ایران گردیده است. در حالیکه تقویت بنیان‌های تولید و بخش‌های مولد، مستلزم بهبود قدرت رقابت و رابطه مبادله است.

در طول دوره مورد بررسی، نسبت باز بودن اقتصاد (مجموع واردات و صادرات به GDP) روندی پرنوسان داشته است. گرچه روند آن در سال‌های اخیر صعودی بوده، لیکن در مقایسه با کشورهای منطقه بسیار پایین می‌باشد.

منابع فارسی:

- ۱- بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، اداره حساب‌های اقتصادی، آمار حساب‌های ملی ایران
- ۲- بررسی عوامل مؤثر بر پس‌انداز بخش خصوصی در ایران، بهرامی، جاوید و اصلانی، پروانه، فصلنامه پژوهش‌های اقتصادی ایران، شماره ۲۳
- ۳- مقایسه وضعیت ایران با کشورهای پیرامونی، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، اداره بررسی‌ها و سیاست‌های اقتصادی، ۱۳۸۶
- ۴- رویکرد تبیین پویایی‌های تورم، بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران، اداره بررسی‌ها و سیاست‌های اقتصادی

In the name of God

**Stylized Facts of the Real Sector
of the Iranian Economy during 1989-2006**

By:

Ali Maroufkhani

**Economic Research and Policy Department
Central Bank of the Islamic Republic of Iran
November 2009**

Abstract

The results of economic and non-economic policies carried out by policy makers are ultimately reflected in the real sector performance of the economy. Moreover, apart from production bottlenecks such as low productivity and efficiency of labor force, capital and technology in this sector, huge oil revenues and oil price fluctuations have affected the structure of the government's expenditure as well as the production cost of corporate sectors. This has led to vulnerabilities in macroeconomic imbalance in monetary and foreign exchange sectors which bring about weaknesses and lack of discipline in government fiscal behavior.

In the current study, we explore the macro indicators of the Iranian economy and compare them with those of regional countries for the years 2000-06 (the review period). With the use of national accounts data of Iran, we have carried out trend and cycle behavior analysis, estimated correlation coefficients, and other characteristics of GDP and GDP components' growth for the countries under study.

The analysis of the macro indicators of the real sector in the review period indicates that although the levels of selected variables are high for Iran, growth and per capita of these variables in comparison with other MENA region countries and with Outlook 1404 Document (Vision Plan) are not appropriate. In addition, the current study shows that the average annual growth of GDP (which is normally used for performance assessment of the country) in Iran was 5.2 percent over the study period which is conceived to be appropriate. However, the high fluctuation and instability of growth performance in Iran compared to other regional countries is a matter of concern.

The major difficulty in Iran's macroeconomic performance does not only stem from large fluctuations and instability in growth of variables like GDP, consumption

and investment, but also from the fact that growth in the Iranian economy is highly import intensive and largely dependent on relatively large inflows of oil income. Moreover, given the very low energy price in Iran, the energy intensity which shows the amount of energy consumption for production of each unit of GDP is indeed very high compared with other countries and it has followed an increasing trend over the review period.

Keywords: Stylized Facts, Real Sector, Macro Indicators, Economic Growth

پژوهشهایی که تاکنون انتشار یافته است

- شماره ۱- پیش‌بینی حجم نقدینگی و شاخص قیمت‌ها با روش باکس و جنکینز
- شماره ۲- بهای انرژی در ایران و جهان
- شماره ۳- بررسی پس‌انداز ملی در ایران طی دوره ۷۴-۱۳۵۳
- شماره ۴- واگذاری سهام شرکت‌های دولتی
- شماره ۵- پیش‌بینی درآمدهای ارزی حاصل از صادرات نفت خام طی دوره ۹۹-۱۳۷۵
- شماره ۶- تحولات اخیر در بازار نفت و اثرات آن بر اقتصاد ایران
- شماره ۷- مالیات بر ارزش افزوده
- شماره ۸- شکاف تولید و متغیرهای موثر بر آن در اقتصاد ایران
- شماره ۹- محاسبه نسبت کفایت سرمایه بانک‌های تجاری و تخصصی در نظام بانکی ایران
- شماره ۱۰- نکاتی در مورد حساب ذخیره تعهدات ارزی
- شماره ۱۱- آزادسازی تجارت خارجی در کشورهای در حال توسعه و تجربه ایران
- شماره ۱۲- سازوکار عرضه پول در اقتصاد ایران
- شماره ۱۳- سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی
- شماره ۱۴- بررسی تاثیر اعتبارات بانکی بر سرمایه‌گذاری و تولید در اقتصاد ایران با تاکید بر بخش‌های صنعت و معدن و کشاورزی
- شماره ۱۵- بررسی وضعیت معافیتهای مالیاتی در ایران
- شماره ۱۶- خصوصی‌سازی
- شماره ۱۷- تسهیلات تکلیفی و اثرات آن بر سیستم بانکی کشور
- شماره ۱۸- بررسی تاثیر حذف یارانه برخی کالاهای اساسی بر دهک‌های درآمدی به تفکیک خانوارهای شهری و روستایی
- شماره ۱۹- بررسی وضعیت چک‌های بانکی در شبکه بانکی کشور
- شماره ۲۰- بررسی وجود حباب قیمتی در بورس اوراق بهادار تهران طی سالهای اخیر
- شماره ۲۱- بررسی رابطه تورم و پول در اقتصاد ایران براساس مدل پیش‌بینی تورم P^*
- شماره ۲۲- تجاری کردن کشاورزی در ایران
- شماره ۲۳- مکانیسم وصول درآمد حاصل از صادرات نفت، فرآورده‌های نفتی و گاز در ایران
- شماره ۲۴- بررسی بهره‌وری در اقتصاد ایران
- شماره ۲۵- تغییر در ارزش داراییهای خارجی بانک مرکزی رویه‌های حسابداری و ملاحظات سیاستی
- شماره ۲۶- نقش بانک مسکن در تامین مالی مسکن
- شماره ۲۷- ابعاد گوناگون فقر در ایران
- شماره ۲۸- بازار رهن و نارسایی تامین مالی مسکن در ایران
- شماره ۲۹- اندازه دولت در اقتصاد ایران
- شماره ۳۰- بررسی مقایسه‌ای شاخص‌های فضای کسب و کار در ایران و جهان
- شماره ۳۱- تورم، نااطمینانی تورم و پراکندگی قیمت‌های نسبی در ایران
- شماره ۳۲- کاربرد الگوریتم ژنتیک در ترکیب پیش‌بینی‌های تورم
- شماره ۳۳- شاخص‌های کمی نمودن فن‌آوری و جایگاه ایران در مقایسه‌های بین‌المللی
- شماره ۳۴- استخراج پهنای نااطمینانی پیش‌بینی تورم
- شماره ۳۵- سازماندهی تولید
- شماره ۳۶- بررسی ارتباط متقابل شاخص‌های CPI و WPI , PPI
- شماره ۳۷- ریسک‌های کلان و کیفیت سیاست‌گذاری در اقتصاد ایران
- شماره ۳۸- فقر، رشد اقتصادی و توزیع درآمد در ایران (۸۲-۱۳۷۹)
- شماره ۳۹- نظم‌های آماری بخش واقعی در اقتصاد ایران (۸۵-۱۳۶۸)