

## دانشگاه الزهرا

### دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی

#### پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته توسعه اقتصادی و برنامه ریزی

#### موضوع:

بررسی اثر حق الضرب پول بر رشد اقتصادی و تورم در ایران طی سال های ۱۳۷۷ - ۱۳۴۲

استاد راهنما: سرکار خانم دکتر زهرا افشاری

استاد مشاور: جناب آقای دکتر محمود حائریان

دانشجو: معصومه سلگی

نیمسال دوم سال ۸۰ - ۱۳۷۹

#### چکیده:

بخش اصلی برنامه های توسعه ای در کشورهای در حال توسعه، منجمله ایران، به عهده دولت می باشد و دولت ها در جهت رسیدن به توسعه، وظایف متعددی را عهده دار می باشند. به همین جهت هزینه های آنها بیش از درآمدهایشان بوده و منجر به کسری بودجه خواهد شد. یکی از روش های عمده ای که جهت تامین کسری بودجه توسط دولت اعمال می شود، استقراض از بانک مرکزی و انتشار پول جدید می باشد که آنرا "پولی کردن کسری" گویند. انتشار پول جدید به واسطه استقراض دولت از بانک مرکزی، موجب می گردد که مقادیر مشخصی از منابع موجود در اقتصاد در اختیار دولت قرار گیرد. این منبع درآمد که حق الضرب پول (seigniorang) نامیده می شود، در واقع توانایی دولت در افزایش درآمدهایش از طریق حق قانونی و انحصاری برای انتشار پول می باشد. از آنجا که همواره نمی توان رابطه بی ابهامی بین "حق الضرب پول" و رشد اقتصادی و تورم در اقتصاد برقرار نمود، به بررسی رابطه بین "حق الضرب پول" و رشد اقتصادی و تورم پرداخته شده است.

جهت بررسی رابطه بین "حق الضرب پول"، رشد اقتصادی و تورم از یک مدل خود رگرسیون برداری (VAR) استفاده شده و مدلی برای ایران طی دوره ۱۳۷۷ - ۱۳۴۲ برآورد گردید و توابع عکس العمل ضربه ای و تجزیه واریانس جهت تحلیل مورد استفاده قرار گرفت.

نتایج نشان می دهد که در کوتاه مدت یک رابطه مثبت بین "حق الضرب پول" و رشد اقتصادی وجود دارد، همچنین نتایج حاکی از یک رابطه مثبت و بلند مدت بین "حق الضرب پول" و تورم می باشد.

در پایان، کاهش اتکا به درآمدهای نفتی، اصلاح ساختار مخارج دولت، اصلاح نظام مالیاتی، افزایش کاربری و تعمیق بازارهای سرمایه داخلی، هماهنگی سیاست های پولی و مالی، استقلال بانک مرکزی به عنوان پیشنهاد مطرح شده است.

## فهرست مطالب

### فصل اول: کلیات

مقدمه

تعریف موضوع تحقیق

۱-۲ فرضیات تحقیق

۱-۳ روش تحقیق (متدلوژی)

۱-۴ جامعه آماری و محدوده مورد مطالعه

۱-۵ مشکلات تحقیق

### فصل دوم: کسری بودجه و راههای تأمین آن

مقدمه

کسری بودجه و علل ایجاد آن

مروری بر ادبیات تاریخی مربوط به کسری بودجه

سیاست کسری بودجه

اهداف سیاست کسری بودجه  
عوامل موثر در سیاست کسری بودجه  
راههای تامین کسر بودجه و اثرات آن  
استقراض از خارج  
استقراض از داخل  
استقراض از بانک مرکزی  
ارتباط بین سیاست های پولی و مالی  
حق الضرب پول و عوامل موثر بر آن  
تعریف حق الضرب پول از دیدگاه های مختلف  
آثار اقتصادی تامین کسری بودجه  
آثار اقتصادی کسری بودجه در قالب الگوهای ایستا  
الگوی عمومی  
الگوی کلاسیک  
الگوی کلاسیک جدید  
الگوی پولیون  
الگوی کینزین  
سیاست های پولی و مالی در الگوی پویا  
تقاضای پویا  
عرضه پویا  
سیاست پولی در یک الگوی پویا  
سیاست مالی در یک الگوی پویا  
سیاست کسری بودجه در یک الگوی پویا  
مطالعات انجام شده (پیشینه تحقیق)

## فصل سوم: مروری بر روند کسری بودجه و حق الضرب پول در ایران

تعریف و مفهوم بودجه

۳-۱-۱ تاریخچه بودجه در ایران

۳-۱-۲ انواع بودجه ریزی

۳-۱-۳ نقش اقتصادی بودجه

۳-۲ اجزا تشکیل دهنده بودجه در ایران

۳-۲-۱ بودجه شرکت های دولتی و موسسه های انتفاعی وابسته به دولت

۳-۲-۲ بودجه سایر موسسات

۳-۲-۳ بودجه عمومی دولت

۳-۲-۳-۱ درآمدهای عمومی

۳-۲-۳-۱-۱ درآمدهای عمومی به قیمت های ثابت

۳-۲-۳-۱-۲ ترکیب درآمدهای عمومی

۳-۲-۳-۱-۳ نقش مالیات در تامین مالی دولت

۳-۲-۳-۲ هزینه های دولت

۳-۳ تحلیل وضعیت کسری بودجه و عمومی دولت در ایران

۳-۳-۱ بررسی ارتباط کسر بودجه و بدهی دولت به بانک مرکزی

۳-۳-۱-۱ رتباط بدهی دولت به بانک مرکزی و پایه پولی

۳-۴ تحلیل ارتباط کسری بودجه، تورم و رشد اقتصادی در ایران

۳-۵ بررسی روند حق الضرب پول در ایران

۳-۶ نتیجه گیری

ضمیمه فصل سوم

## فصل چهارم: معرفی و ارائه مدل

مقدمه

۴-۲ معرفی مدل ها

۴-۳ معرفی متغیرهای مدل

۴-۴ بررسی ایستایی متغیرها

۴-۵ انتخاب رتبه بهینه در الگوی خود توضیح برداری

۴-۶ تجزیه واریانس

۴-۶-۱ تجزیه واریانس تورم

۴-۶-۲ تجزیه واریانس رشد تولید حقیقی

۴-۷ تابع عکس العمل ضربه ای

ضمیمه فصل چهارم

۴-۱ مقدمه

۴-۲ سری های زمانی پایا (ایستا)

۴-۳ آزمون ایستایی

۴-۳-۱ آزمون ایستایی با استفاده از همبستگی نگار و تابع خود همبستگی

۴-۳-۲ آزمون باکس - پیرس و لجانگ باکس

۴-۳-۳ آزمون ریشه واحد دیکی - فولر

۴-۳-۴ آزمون دیکی - فولر تعمیم یافته (ADF)

۴-۳-۵ آزمون پرون

۴-۴ رگرسیون جعلی

۴-۵ الگوی خود توضیح برداری (VAR)

الف - تابع عکس العمل ضربه ای

ب - تجزیه واریانس

## فصل پنجم: نتیجه گیری و پیشنهادات

نتیجه گیری

پیشنهادات