

بِسْمِ تَعَالَى

پژوهشکده مطالعات اقتصادی و صنعتی شریف

بررسی ابعاد دخالت‌های غیربودجه‌ای دولت

در اقتصاد ایران

حسن درگاهی

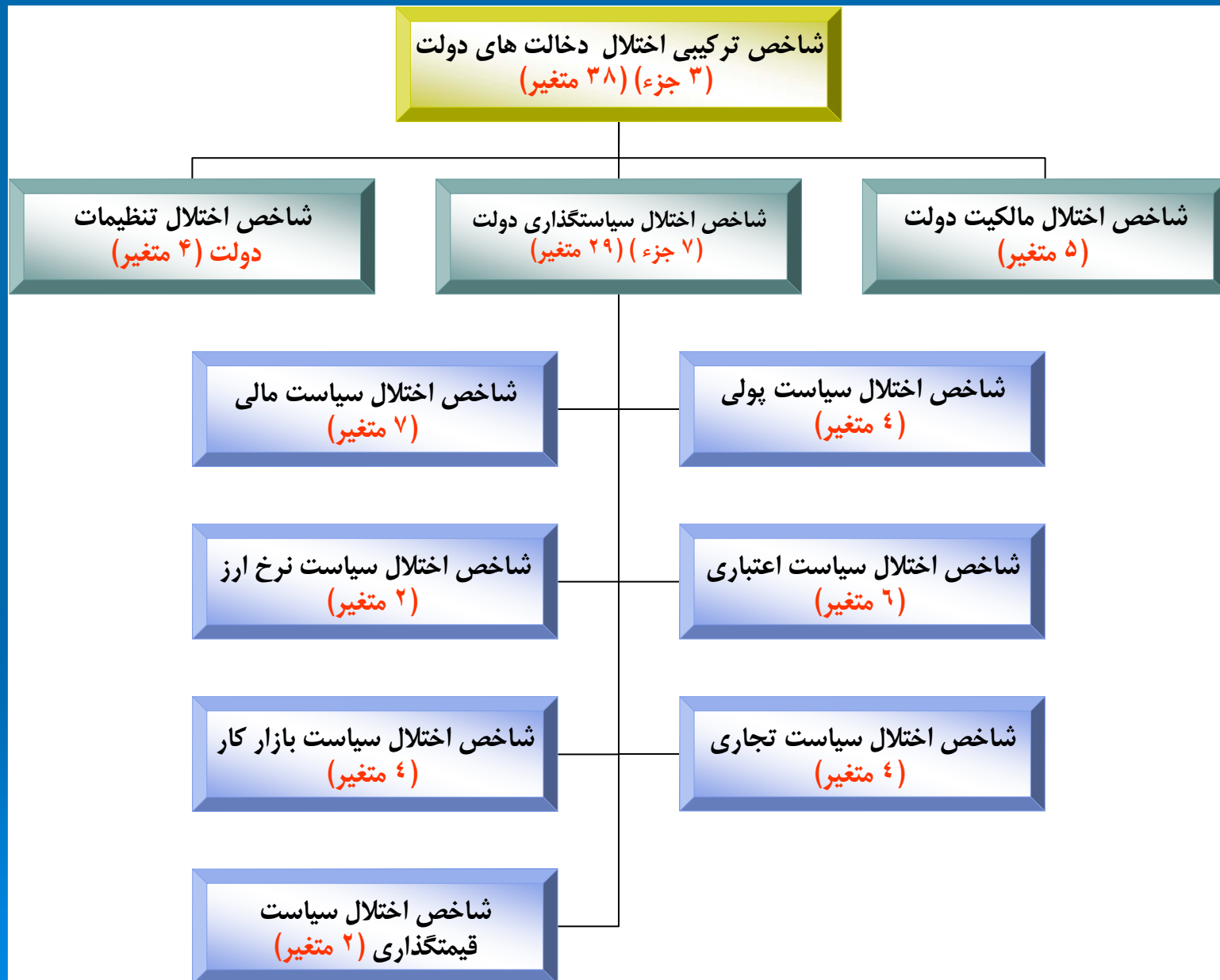
➤ هدف مطالعه، بررسی ابعاد دخالت‌های غیربودجه‌ای دولت در اقتصاد ایران، بر اساس ساخت و اندازه‌گیری شاخص‌های کمی است.

➤ دخالت‌های غیربودجه‌ای دولت در حوزه‌های **سیاست‌گذاری، تنظیمات، و مالکیت و تصدی**، طبقه‌بندی شده و **شاخص اختلال دولت** برای دوره ۸۱-۱۳۴۰ اندازه‌گیری می‌شود.

➤ همچنین **شاخص اثربخشی دولت** بر اساس مجموعه‌ای از شاخص‌های اقتصادی و سیاست‌گذاری تعریف و مورد اندازه‌گیری قرار می‌گیرد.

➤ محاسبه دو شاخص مهم **اختلال دولت و اثربخشی دولت** این امکان را فراهم می‌سازد تا نقش دولت در تحولات رشد اقتصادی ایران، در کنار سایر تعیین‌کننده‌های رشد، به درستی تبیین گردد.

اجزای شاخص ترکیبی اختلال دخالت های دولت



روش ساخت شاخص های اختلال

➤ پس از انتخاب مجموعه متغیرهای هر شاخص اختلال، جهت اختلال زایی هر متغیر تعریف و مقادیر متغیر به اعداد بین صفر و ده تبدیل شدند.

➤ عدد صفر نشان دهنده کمترین اختلال و عدد ده نشان دهنده بیشترین اختلال است.

➤ متغیرهای مختلف با استفاده از دو روش رگرسیون عناصر دورانی و روش عناصر اساسی باهم ترکیب شده و شاخص های ترکیبی اختلال ساخته شدند.

شاخص اختلال سیاست مالی

➤ مکانیزم های اختلال سیاست مالی:

- تخصیص سیاسی و نه اقتصادی منابع
- بازتوزیع درآمد از طریق یارانه های ناکارا
- هزینه ناکافی در تولید کالاهای عمومی
- اجرای سیاست های مالیاتی ناکارا

➤ اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست مالی:

➤ سیاست مالیاتی

- نرخ مالیات بر درآمد (نسبت مالیات مستقیم به GDP)
- نرخ مالیات بر شرکتها

➤ پرداخت یارانه های ناکارا:

- سهم یارانه های مصرفی از کل یارانه های پرداختی
- تفاضل میزان سرانه یارانه پرداختی در حالت پوشش ۴۰ درصد طبقه کم درآمد و میزان سرانه یارانه در حالت پوشش کل جمعیت

➤ تخصیص سیاسی منابع

- بهره وری متوسط سرمایه در بخش عمومی دولت
- انحراف بازده نهایی سرمایه از هزینه بکارگیری سرمایه

➤ هزینه ناکافی در تولید کالاهای عمومی

- نسبت هزینه های آموزشی و تحقیقاتی به تولید ناخالص داخلی

شاخص اختلال سیاست پولی

➤ مکانیزم های اختلال سیاست پولی:

- ایجاد فضای نااطمینانی در اقتصاد و غیرقابل پیش بینی شدن آینده توسط عاملان اقتصادی و در نتیجه کوتاه تر شدن افق تصمیمات اقتصادی و کاهش سرمایه گذاری
- ایجاد تورم: اثرات بی ثباتی و باز توزیعی
- روش انتشار پول در تأمین کسری بودجه

➤ اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست پولی:

- - نرخ تورم
- - انحراف معیار تورم
- - تفاوت رشد نقدینگی و رشد اقتصادی
- - مالیات تورمی (نرخ تورم ضربدر حجم حقیقی پول)

شاخص اختلال سیاست اعتباری و بانکی

- مکانیزم های اختلال سیاست اعتباری:
- ایجاد شکاف بین بازده نهایی وام با هزینه اجتماعی آن از طریق:
- دخالت در **کارکرد تخصیصی** بازارهای مالی
 - سهمیه بندی اعتبار و تخصیص اعتبارات گزینشی
 - کنترل نرخ بهره سپرده و وام
- دخالت در **کارکرد حاکمیتی** بازارهای مالی
 - مالکیت دولتی
 - تنظیم مقررات ورود به بازار
- اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست اعتباری:
- تأثیر دولت بر تخصیص اعتبارات (سهم تسهیلات تکلیفی از کل تسهیلات)
- سهم اعتبارات بخش خصوصی از کل اعتبارات
- کنترل نرخ بهره (نرخ بهره واقعی)
- تملک دولتی موسسات مالی و بانکها
- محدودیت بانک های خارجی در افتتاح شعب در کشور
- آزادی شهروندان در افتتاح حساب ارزی در داخل و خارج

شاخص اختلال سیاست تجاری

➤ مکانیزم های اختلال سیاست تجاری:

- اعمال محدودیت های تجاری ناکارا و مستمر به صورت **موانع تعرفه ای و غیرتعرفه ای**، با هدف حمایت بازار داخلی و بدون به توجه ارتقاء رقابت پذیری
- ساختار تجارت خارجی با اعمال **سیاست درون نگر** جایگزینی واردات
- **بی ثباتی** و نوسان در سیاست های تجاری
- **عدم توسعه بخش تجاری** در مقایسه با اندازه مورد انتظار

➤ اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست تجاری:

- نرخ تعرفه موزون (مالیات بر واردات به کل ارزش واردات)
- انحراف نرخ تعرفه از روند
- اندازه بخش تجاری (مقایسه حجم تجارت در GDP ایران با کشورهای آسیای شرقی)
- جهت گیری صادراتی (نسبت صادرات صنعتی به GDP)

شاخص اختلال سیاست ارزی

- مکانیزم های اختلال سیاست ارزی:
- نظام ارزی مبتنی بر نرخ های ارز دوگانه و چندگانه
- بالا بودن پرمیوم نرخ ارز (انحراف نرخ ارز آزاد از نرخ ارز رسمی)
- انتخاب لنگر نرخ ارز برای کنترل هدف تورم
- تعهدات قوی نسبت به هدف نرخ ارز و تثبیت آن: کاهش رقابت پذیری اقتصاد
- اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست ارزی:
- تفاوت بین نرخ ارز رسمی و نرخ ارز بازار موازی
- نسبت شاخص قیمت کالاهای صادراتی به شاخص قیمت کالاهای تولید و مصرف شده داخلی به عنوان جایگزین شاخص نرخ ارز حقیقی

شاخص اختلال سیاست های بازار کار

- مکانیزم های اختلال سیاست بازار کار :
- انعطاف ناپذیری در عرضه و تقاضای نیروی کار
 - نبود مکانیزم های تخصیص مجدد نیروی کار (ناکارایی نظام تأمین اجتماعی و نظام آموزشی)
 - وجود نیروی کار بزرگ و سازمان یافته در صنایع مورد حمایت و در بخش عمومی
- اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست بازار کار:
- نسبت شاخص دستمزد موزون به شاخص حداقل دستمزد
- امکان استخدام و اخراج نیروی کار توسط کارفرما
- سهم نیروی کار در تعیین دستمزدها: دستمزد حقیقی مورد انتظار
- نسبت اعتبار بودجه فصل تأمین اجتماعی به کل مخارج مصرفی دولت

شاخص اختلال سیاست قیمت گذاری

- مکانیزم های اختلال سیاست قیمت گذاری:
- سیاست قیمت گذاری برای قیمت برخی از نهاده ها، با هدف کاهش تورم چندان دارای پشتوانه نظری و تجربی نیست.
- در ادبیات اقتصادی حتی دلایل مدافعین تثبیت قیمت ها، مبنی بر هدف کاهش تورم نیست بلکه استدلال می شود که این سیاست، هزینه سیاست های ضد تورمی را کاهش می دهد.
- شواهدی وجود دارد که حتی کنترل ها می تواند به جای کاهش تورم، در نهایت منجر به تورم بیشتر گردد. چرا که کنترل ها باعث انحراف تلاش دولت از تمرکز بر استفاده از سیاست پولی برای مقابله با تورم می گردد.
- سیاست کنترل قیمت و دستمرد به جهت تشکیل صف برای دریافت کالای سهمیه بندی شده، تلاش برای طفره های قانونی و غیر قانونی از کنترل ها، باعث اتلاف و تخصیص ناکارای منابع و در نهایت منجر به کاهش تولید می گردد.

شاخص اختلال سیاست قیمت گذاری

➤ اجزای شاخص ترکیبی اختلال سیاست قیمت گذاری:

- قیمت نسبی محصولات صنعتی

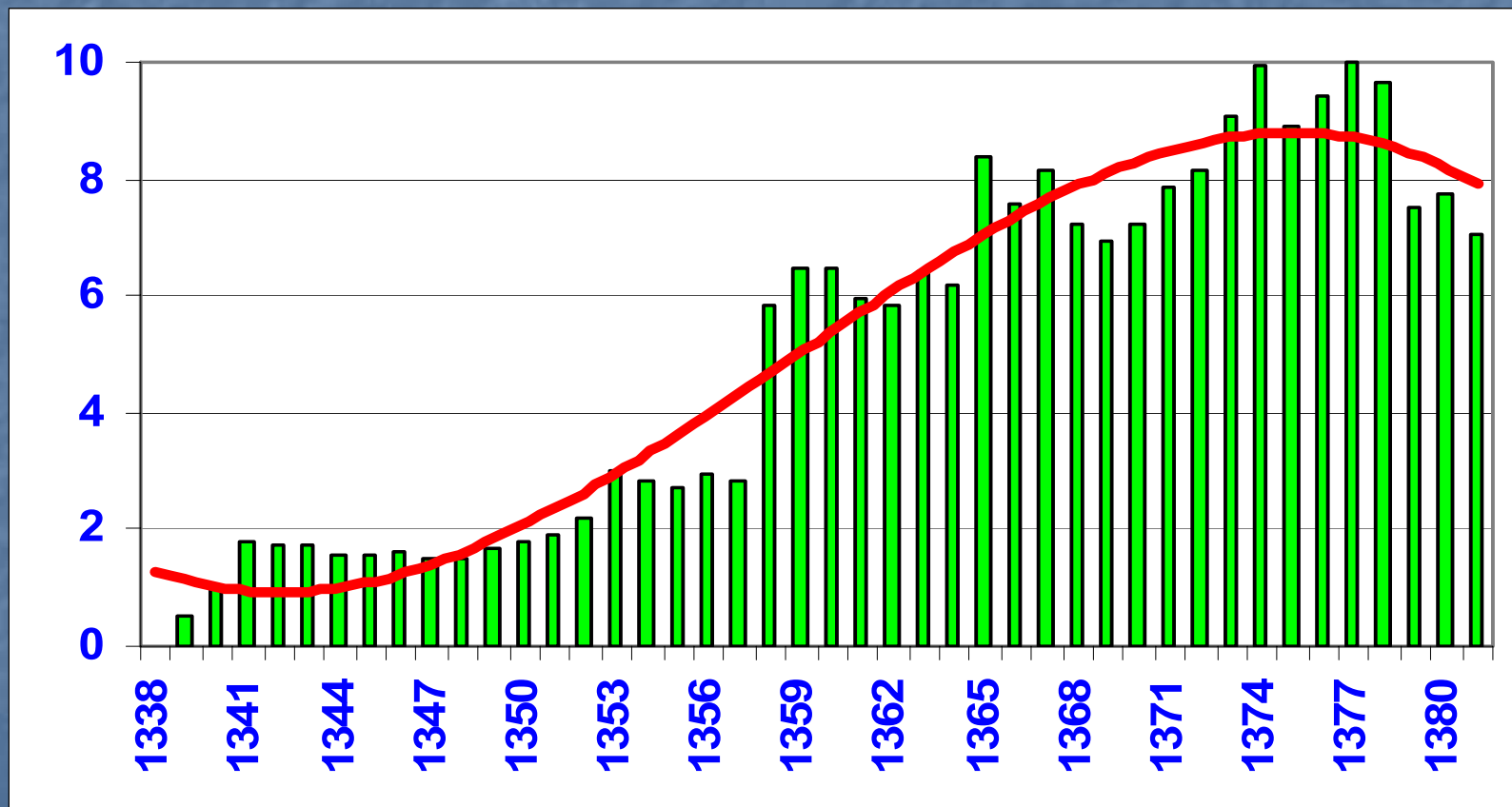
- قیمت نسبی انرژی (بنزین)

➤ ویژگی مشترک هر دو شاخص کمتر از یک بودن آن ها بعد از سال ۱۳۵۹ و روند کاهشی آن ها است. به عبارت دیگر روند افزایشی قیمتها بیش از افزایش قیمت های انرژی و محصولات صنعتی بوده و این فاصله همچنان بیشتر شده است.

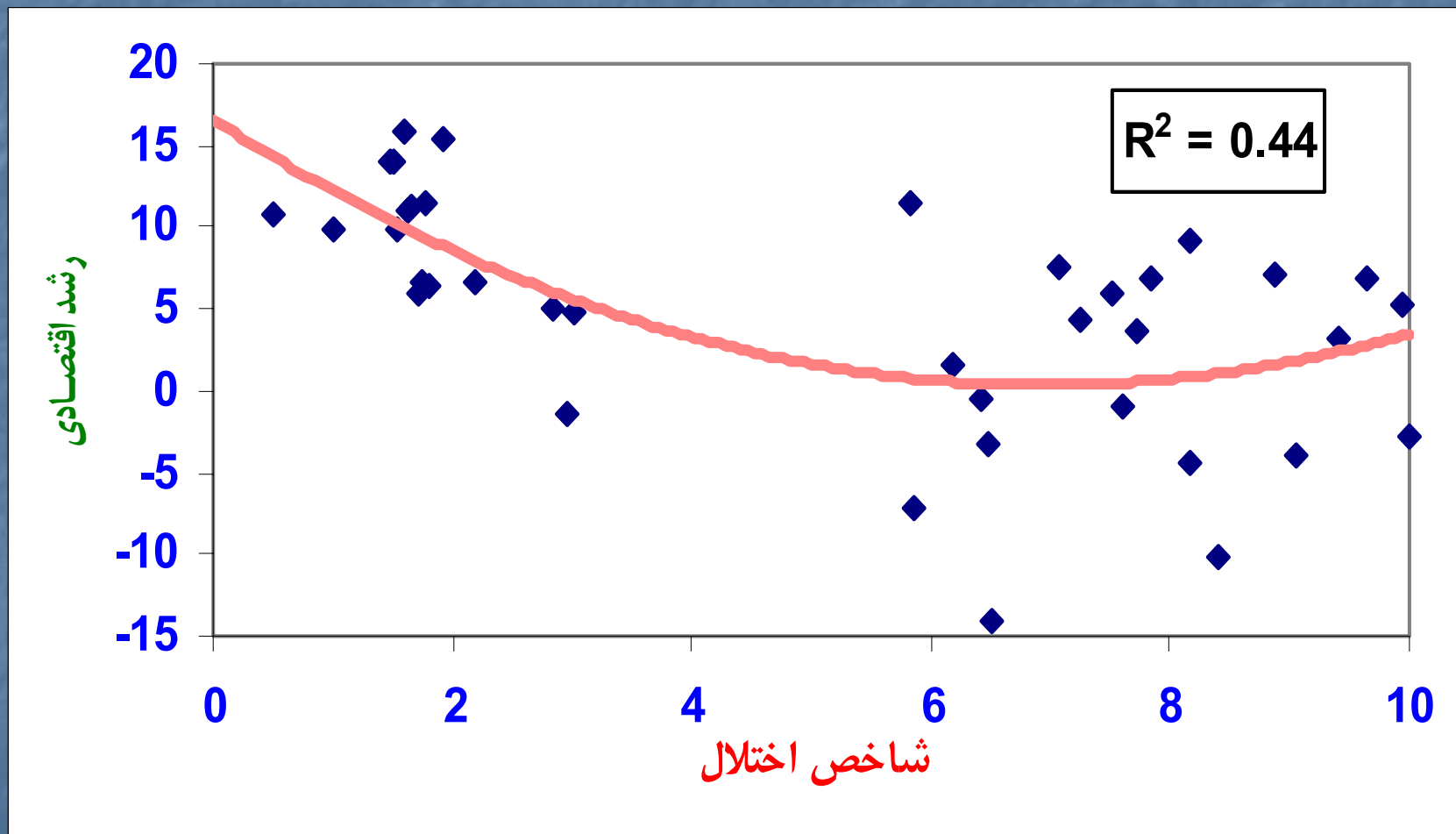
➤ کمترین مقدار قیمت های نسبی به عنوان بیشترین اختلال دولت از طریق سیاست قیمت گذاری فرض شده است.

شاخص ترکیبی اختلال سیاستگذاری دولت

($0 =$ اختلال کمتر، $10 =$ اختلال بیشتر)



رابطه رشد اقتصادی با شاخص اختلال سیاستگذاری دولت



شاخص اختلال تنظیمات اقتصادی

■ مکانیزم های اختلال تنظیمات دولت:

■ تعدد قوانین و مقررات

■ مقررات سخت و دشوار و غیر قابل انعطاف (مانند ملزومات اخذ مجوز برای شروع یک فعالیت قانونی)

■ کنترل قیمتها و ایجاد محیط رانتي برای بنگاه ها فارغ از هرگونه دغدغه (اعم از رقابت، بهبود کیفیت محصول، کاهش هزینه تولید) و تولید محصولات کم کیفیت و گران در مقایسه با تولیدات خارجی

■ حمایت های غیر هدفمند و زمان بندی نشده به بهانه حمایت از تولید داخلی و حفظ اشتغال

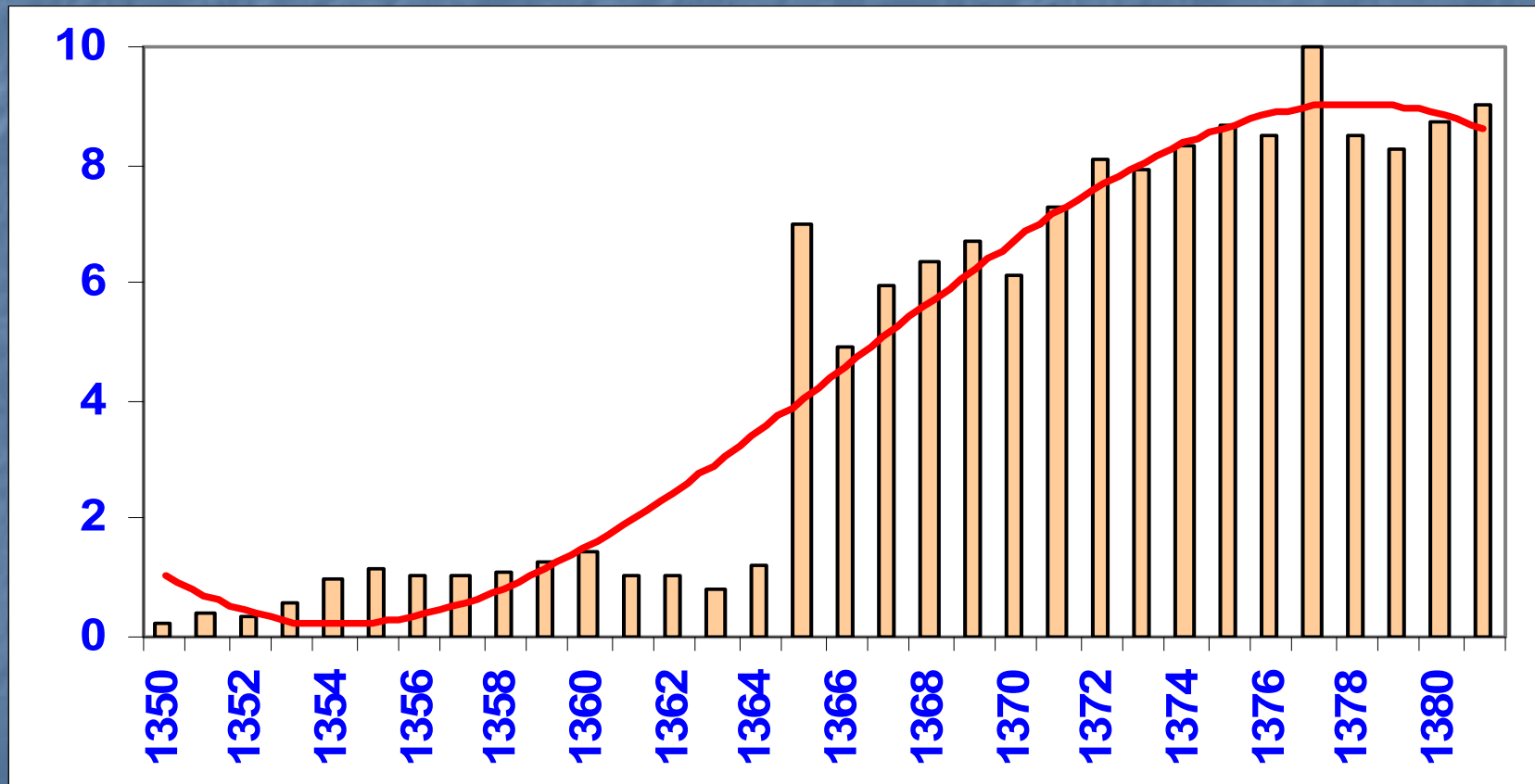
■ موانع توسعه رقابت در بازارهای داخلی و ناکارآمدی و تساهل سیاست ضد انحصار

شاخص اختلال تنظیمات اقتصادی

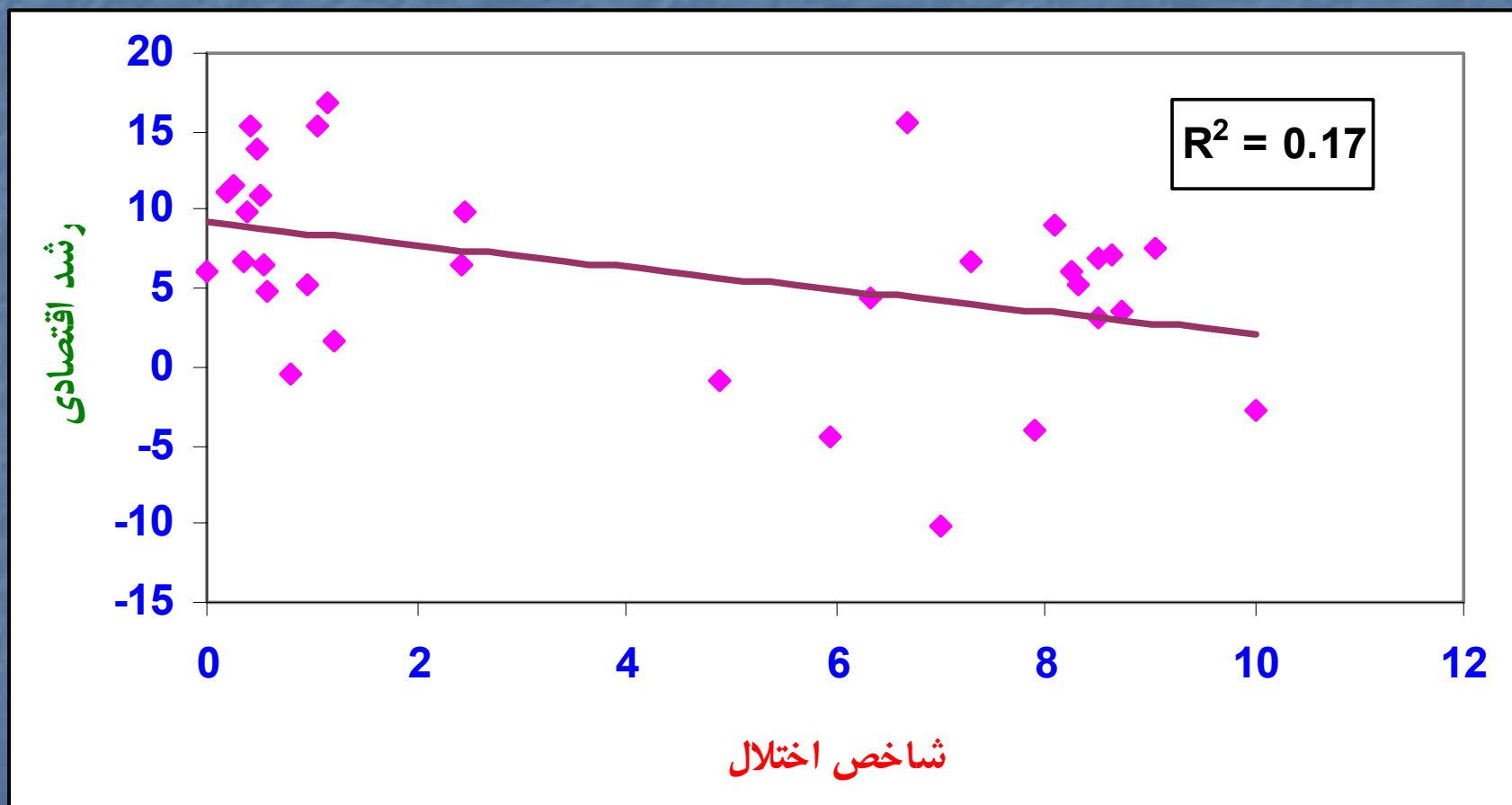
- اجزای شاخص ترکیبی اختلال تنظیمات اقتصادی
- حمایت های یارانه ای: سهم یارانه ها از مخارج دولت
- بقای تصنیعی صنایع در اثر یارانه های دولتی: نسبت شاخص قیمت صنعت به شاخص قیمت عمده فروشی
- تعرفه های اعمال شده بر تجارت: نسبت مالیات بر واردات به کل واردات
- رقابت پذیری بنگاه ها: نسبت شاخص قیمت کالاهای صادراتی به شاخص قیمت کالاهای تولید و مصرف شده داخلی

شاخص ترکیبی اختلال تنظیمات اقتصادی

($0 =$ اختلال کمتر، $10 =$ اختلال بیشتر)



رابطه رشد اقتصادی با شاخص اختلال تنظیمات اقتصادی دولت



شاخص اختلال مالکیت و تصدی های دولت

◆ مکانیزم های اختلال مالکیت و تصدی دولت:

❖ نقش **SOEs** در بازارهای رقابتی یا بازارهایی که مستعد رقابت پذیری هستند، ضعیف است. در ساختارهای رقابتی تغییر به مالکیت خصوصی می تواند منجر به عواید کارایی مهمی شود.

❖ ماهیت دولتی مالکیت بنگاه ها منجر به مسائلی در تعریف **اهداف بنگاه** می گردد. دولت ممکن است اهداف دیگری بیش از حداکثرسازی سود سهام داران را دنبال کند.

❖ **هزینه های معاملاتی** مداخله دولت در فرایند تولید و سایر تصمیمات بنگاه وسیع تر است.

❖ برای بنگاه های دولتی انضباط حاکم بر بنگاه های خصوصی از جانب بازارهای سرمایه و تهدیدات ناشی از بحرانهای مالی، از اهمیت کمتری برخوردار است. **اتکای بنگاه های ناموفق به بودجه دولت** عامل مهمی در ناکارآمدی بنگاه های دولتی است.

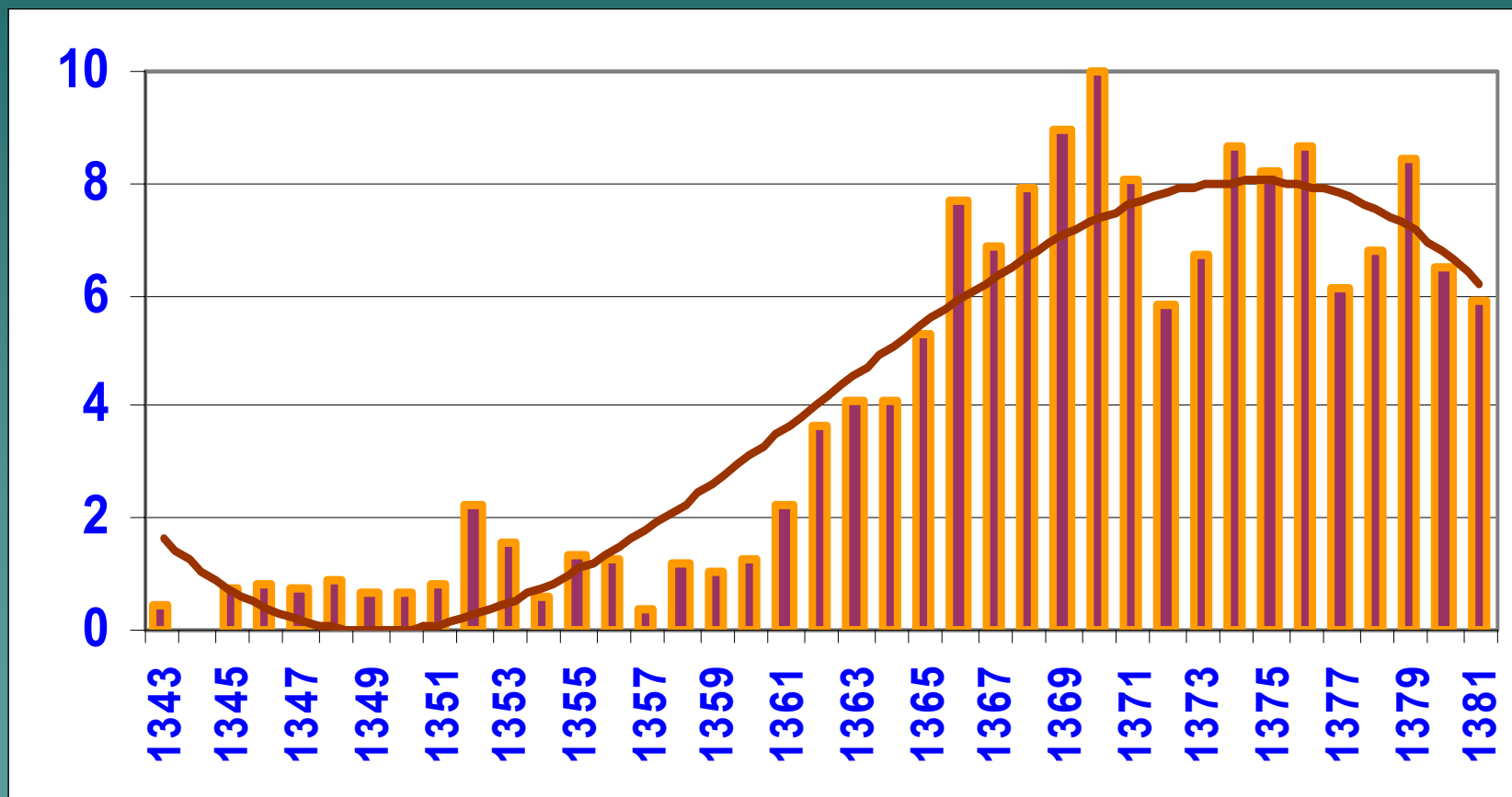
شاخص اختلال مالکیت و تصدی های دولت

◆ اجزای شاخص ترکیبی اختلال مالکیت و تصدی

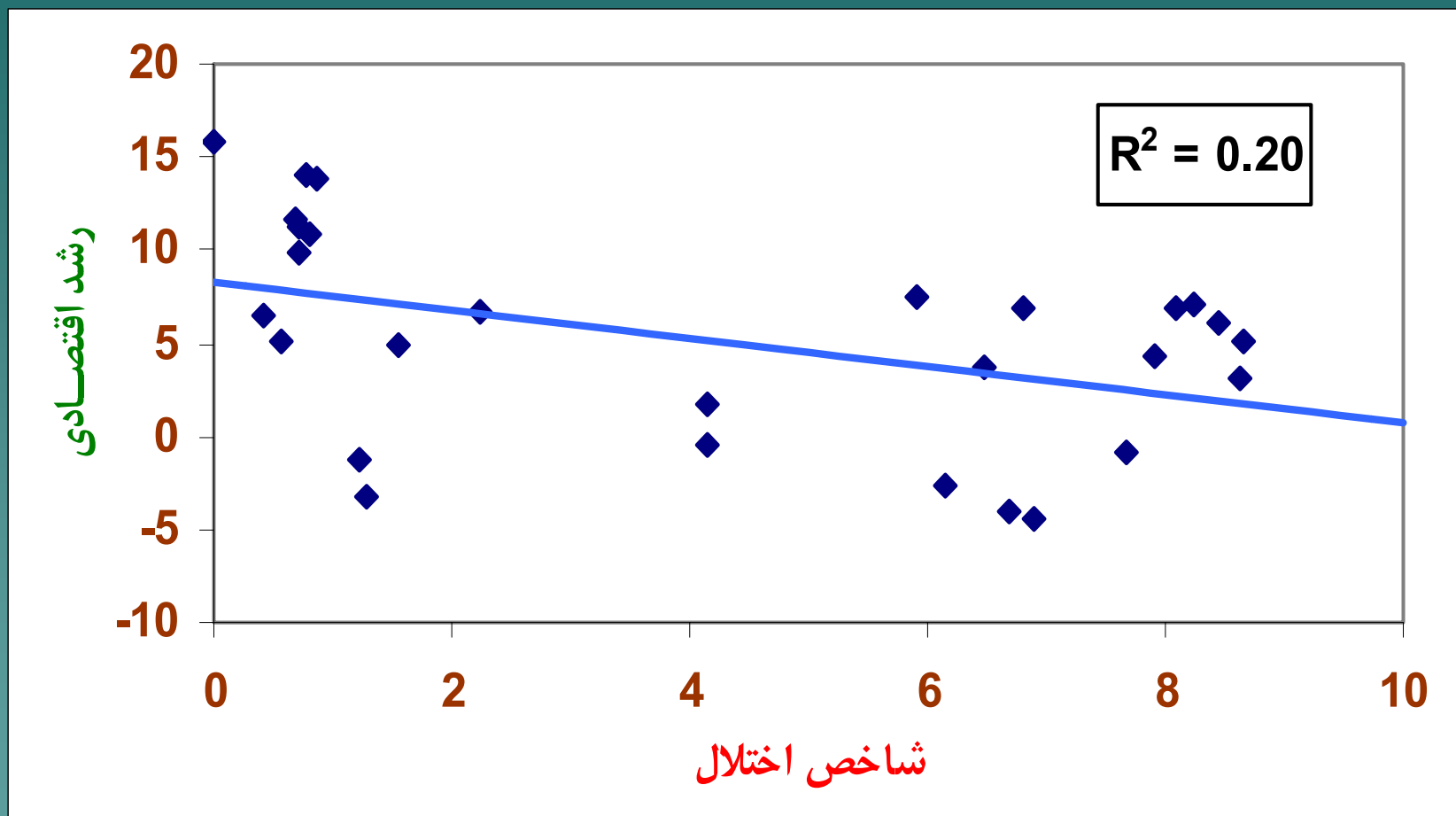
- سهم مخارج مصرفی دولت از تولید ناخالص داخلی
- درآمد حاصل از مالکیت شرکت های دولتی به تولید ناخالص داخلی
- نسبت فروش ناخالص شرکت های دولتی به ارزش ستانده کل
- نسبت اشتغال بخش عمومی به کل اشتغال
- نسبت اعتبار مربوط به جبران خدمت کارکنان دولت به تولید ناخالص داخلی

شاخص ترکیبی اختلال مالکیت و تصدی

(۰ = اختلال کمتر، ۱۰ = اختلال بیشتر)



رابطه رشد اقتصادی با شاخص اختلال مالکیت و تصدی دولت



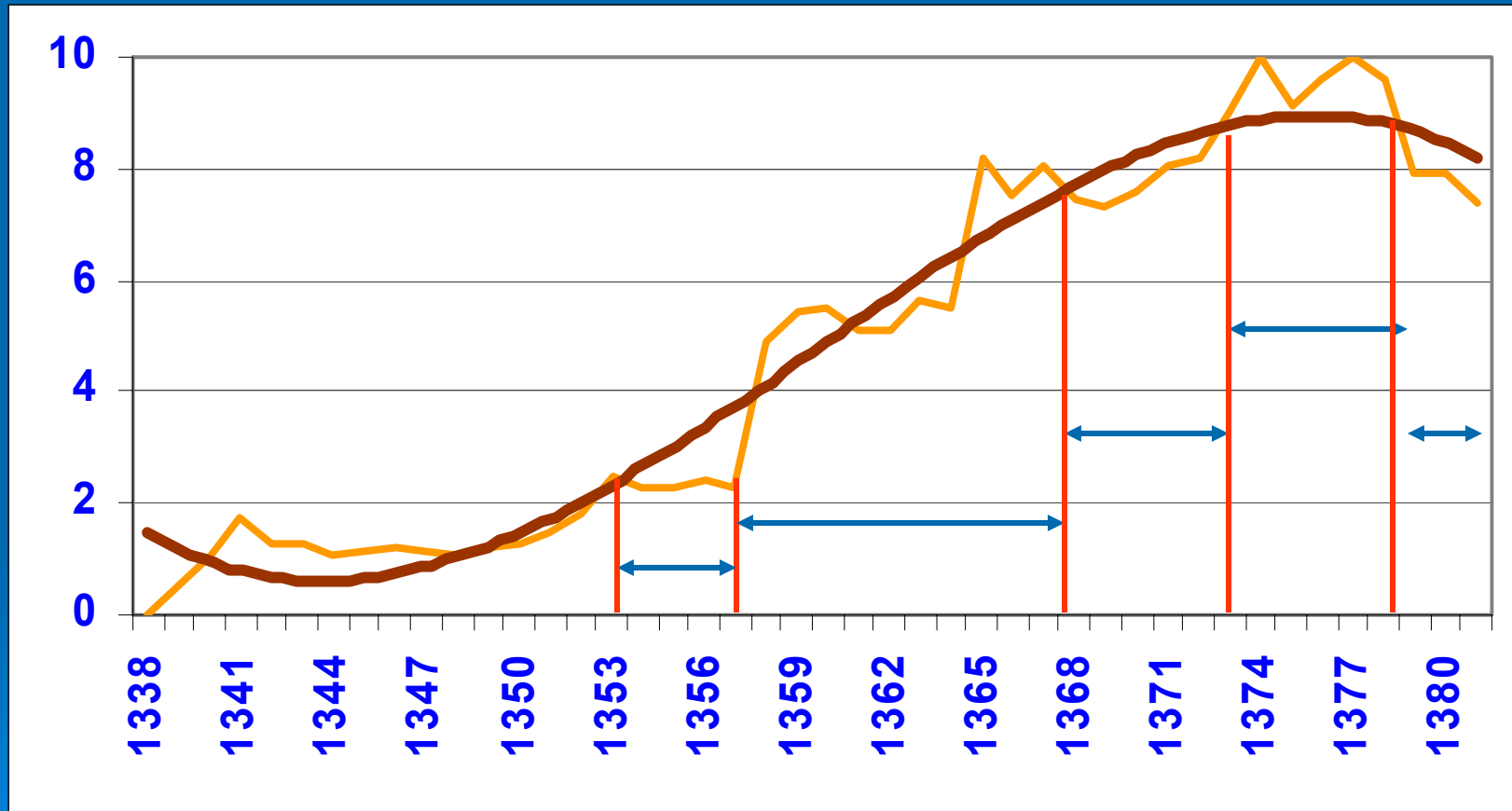
ساخت شاخص کل اختلال دخالت های دولت

Government Distortion Index

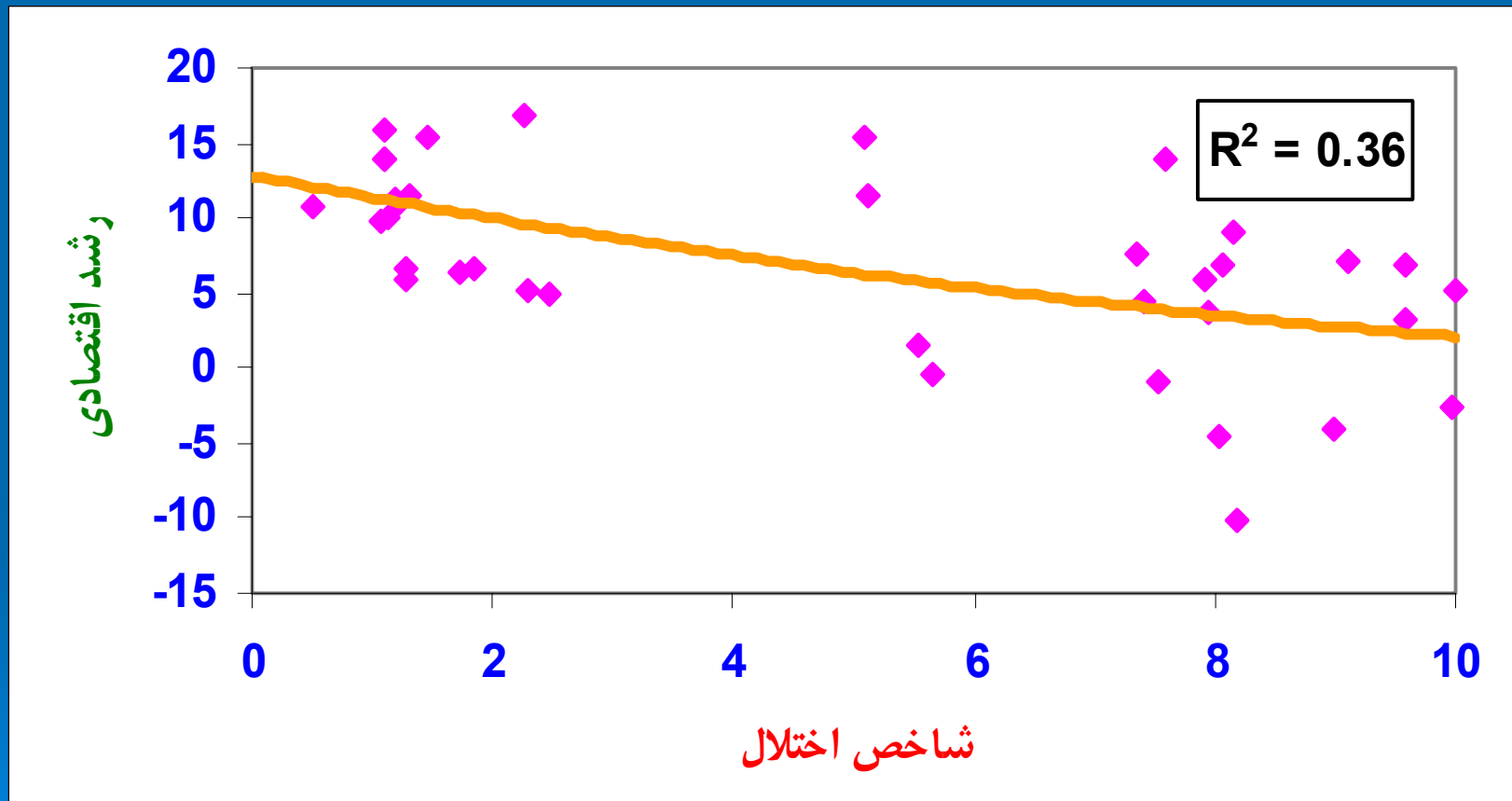
- با ترکیب شاخص اختلال سیاستگذاری، شاخص اختلال تنظیمات و شاخص اختلال مالکیت و تصدی دولت، شاخص کل اختلال دولت در اقتصاد ایران ساخته می شود.
- این شاخص ترکیبی در مجموع از ۳۸ متغیر تشکیل شده است.
- شاخص کل اختلال دولت می تواند به همراه مخارج بودجه ای در تبیین هر چه بهتر نقش دولت در رشد اقتصادی مورد استفاده قرار گیرد.
- شاخص مذکور به صورت سری زمانی و برای سالهای ۱۳۸۱-۱۳۳۸ محاسبه و مقدار آن بین صفر و ده اندازه گیری شد.

شاخص کل اختلال دخالت های دولت

($0 =$ اختلال کمتر ، $10 =$ اختلال بیشتر)



رابطه رشد اقتصادی با شاخص کل اختلال دولت



اختلال دخالت های دولت: جمع بندی

- تمامی شاخص های اختلال بر رشد اقتصادی اثر منفی دارند.
- قدرت توضیح دهندگی تحولات رشد اقتصادی توسط شاخص های مختلف اختلال در هر دو روش رگرسیون عناصر دورانی و روش عناصر اساسی تا حدود زیادی یکسان بوده و نتایج مشابهی را در بر دارد.
- ضریب تعیین R^2 رابطه رشد اقتصادی با شاخص کل اختلال دولت در روش اول معادل ۰,۴۳ و در روش دوم معادل ۰,۳۶ است.
- در بین اجزای مختلف شاخص کل اختلال دولت، شاخص اختلال سیاستگذاری دولت با ضریب تعیین ۰,۴۴ بیشترین قدرت توضیح دهندگی تحولات رشد اقتصادی را دارا بوده و پس از آن شاخص های اختلال مالکیت و تنظیمات دولت قرار دارند.

اختلال دخالت های دولت: جمع بندی

➤ در بین سه جزء اصلی شاخص ترکیبی اختلال، شاخص اختلال سیاستگذاری با ۵۵ درصد دارای بیشترین وزن است و پس از آن شاخص های مالکیت و تنظیمات به ترتیب با ۲۷ و ۱۸ درصد اوزان تشکیل دهنده شاخص کل اختلال دولت می باشند.

➤ اوزان اجزای شاخص اختلال در جهت گیری انجام اصلاحات به منظور کاهش اختلال دخالت های دولت بسیار تعیین کننده است زیرا نشان می دهد:

- آثار منفی دخالت های دولت بطور عمده از کانال سیاست های اقتصادی دولت است.
- وزن اختلال دولت از کانال مالکیت و تصدی بیش از تنظیمات دولتی است. این واقعیت نشان دهنده آن است که در اقتصاد ایران کاهش مالکیت و تصدی های دولتی و جایگزین شدن آن با تنظیمات دولتی در مجموع آثار مثبتی بر رشد اقتصادی خواهد داشت.

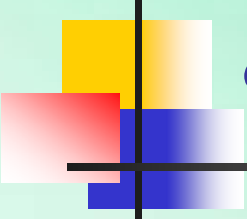
اختلال دخالت های دولت: جمع بندی

- مقایسه ضرایب اهمیت اجزای شاخص اختلال سیاستگذاری دولت نشان می دهد که اختلال سیاست های پولی و اعتباری با وزن ۳۵ درصد بیشترین ضریب اهمیت را دارا می باشد.
- پس از آن اختلال سیاست های تجاری و نرخ ارز با ۲۵ درصد در درجه دوم اهمیت نسبی قرار دارد.
- اوزان اختلال سیاست های بازار کار، مالی و قیمت گذاری به ترتیب معادل ۱۴، ۱۳ و ۱۳ درصد محاسبه شده است.



ساخت شاخص اثربخشی دولت مؤلفه ای از حاکمیت خوب

- اجزای شاخص ترکیبی اثربخشی دولت:
- سطح کیفیت و مهارت های فنی و اجرایی کارکنان بخش عمومی
 - ترکیب تحصیلات کارکنان بخش عمومی
 - سرانه جبران خدمت کارکنان بخش عمومی به قیمت ثابت
- توانایی دولت در فرموله کردن و اجرای سیاست های ملی
 - نسبت درآمد نفت به درآمدهای کل دولت
- توانایی دولت در انعکاس شرایط و واکنش موثر به مسائل اقتصاد داخلی
 - انحراف از روند تولید ناخالص داخلی
 - انحراف از روند تورم



ساخت شاخص اثربخشی دولت مؤلفه ای از حاکمیت خوب

- توانایی دولت در ایجاد، ارائه و حفظ زیرساخت ها
 - نسبت اعتبار فصول زیر بنایی بودجه به کل اعتبارات عمرانی دولت
- توانایی دولت در اجرای سیاست های مالی
 - انحراف عملکرد سیاست های مالی از سیاست های پیش بینی شده
 - مانده بدهی بخش دولتی به سیستم بانکی از تولید ناخالص داخلی
 - کارایی دولت در جمع آوری مالیات
 - نسبت عملکرد مالیات به مالیات مصوب
 - نسبت عملکرد مالیات به تولید ناخالص داخلی

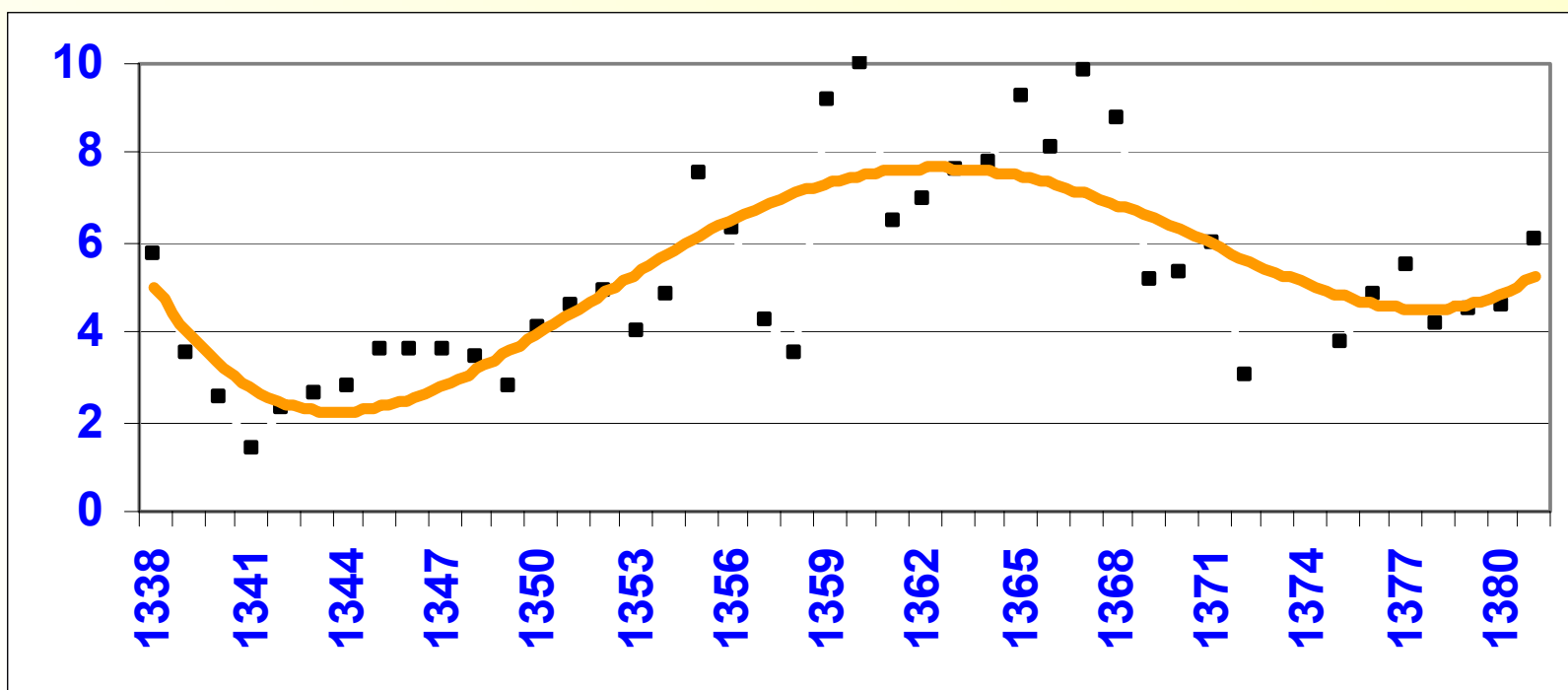


ساخت شاخص اثربخشی دولت مؤلفه ای از حاکمیت خوب

- توانایی دولت در اجرای سیاست های پولی
 - انحراف عملکرد سیاستهای پولی از سیاستهای پیش بینی شده
 - مزمن بودن تورم
 - تفاضل نرخ رشد نقدینگی از مجموع نرخ های تورم و رشد اقتصادی
- مدیریت بدهی خارجی
 - نسبت بدهی خارجی به تولید ناخالص داخلی
- وجود و یا عدم وجود قوانین مهم از جمله قانون سرمایه گذاری خارجی،
قانون رقابت و انحصار

شاخص ترکیبی اثربخشی دولت

(۰ = اثربخشی بیشتر ، ۱۰ = اثربخشی کمتر)





ساخت شاخص اثربخشی دولت

- شاخص اثربخشی دولت در اقتصاد ایران با ترکیب دوازده شاخص و به صورت سری زمانی برای سال های ۱۳۸۱-۱۳۳۸ محاسبه و مقادیر آن بین صفر (اثربخشی بیشتر) و ده (اثربخشی کمتر) اندازه گیری شد.
- در دهه ۱۳۴۰ مقدار شاخص کمتر از ۴ بوده است. بعد از شوک مثبت نفتی اول شاخص به بیش از ۵ و در سالهای انقلاب و جنگ به مقدار ۱۰ یعنی کمترین اثربخشی در دوره مورد بررسی می رسد.
- در سال های برنامه اول روند کلی اثربخشی دولت بهبود و در سال های برنامه دوم تضعیف می گردد، از سال ۱۳۷۹ که اقتصاد ایران شوک مثبت نفتی را تجربه می کند مجدداً اثربخشی روند کاهشی نشان می دهد.
- در سال ۱۳۸۱ مقدار شاخص بطور نسبی معادل ۶ رتبه بندی می شود که نشان دهنده سطح اثربخشی کمتر از متوسط است.
- کاهش اثربخشی دولت اثر منفی بر رشد اقتصادی دارد.

رابطه رشد اقتصادی با شاخص اثربخشی دولت

