

## بررسی رابطه علی میان گردشگری و رشد اقتصادی در کشورهای عضو منطقه منا

محمد رضا کهنسال و امیرحسین توحیدی \*

تاریخ وصول: ۱۳۹۴/۱/۱۷      تاریخ پذیرش: ۱۳۹۴/۷/۳۰

چکیده:

بازار گردشگری از پتانسیل بسیار بالایی در ایجاد درآمدهای ارزی و افزایش اشتغال برخوردار است و توجه به این صنعت می‌تواند نقش بسیار مهمی در روند توسعه اقتصادی ایران و سایر کشورهای عضو منطقه منا داشته باشد. لذا، این سؤال مطرح می‌گردد که چه رابطه‌ای میان گردشگری و رشد اقتصادی وجود دارد؟ با توجه به شرایط بسیار ویژه و منحصر به فرد ایران و کشورهای عضو منطقه منا از لحاظ مناظر طبیعی، تاریخی، فرهنگ و مذهب، هدف اصلی این مطالعه بررسی رابطه علی میان گردشگری و رشد اقتصادی در کشورهای عضو منا طی دوره‌ی ۱۹۹۵-۲۰۱۲ است. برای این منظور، از روش VAR در چارچوب داده‌های تابلویی و آزمون علی دومیترسکو-هولنین استفاده شده است که از این لحاظ، وجه تمایز این مطالعه نسبت به مطالعات پیشین است. نتایج مطالعه نشان داد که نظریه رشد گردشگری با محوریت اقتصادی در کشورهای عضو منطقه منا برقرار می‌باشد. لذا، پیشنهاد می‌گردد که ایران و سایر کشورهای عضو این منطقه با سرمایه‌گذاری در صنایع پیشرو و توسعه زیرساخت‌ها، شرایط لازم برای رشد اقتصادی را فراهم آورند تا صنعت گردشگری این کشورها نیز منتفع گردد.

طبقه‌بندی JEL: F43, L83

واژه‌های کلیدی: رشد اقتصادی، گردشگری، آزمون علیت

\* به ترتیب، استاد و دانشجوی دکتری گروه اقتصاد کشاورزی، دانشکده کشاورزی، دانشگاه فردوسی مشهد.  
[\(kohansal@um.ac.ir\)](mailto:kohansal@um.ac.ir)

## ۱- مقدمه

گرددشگری بزرگترین صنعت جهان به شمار می‌رود و یکی از سریع‌ترین بخش‌های روز به رشد را شامل می‌شود، به طوری که بیش از یک سوم ارزش کل تجارت خدمات در سطح جهانی را به خود اختصاص داده است. میزان گرددشگری از ۲۵ میلیون گرددشگر در سال ۱۹۵۰ به بیش از ۸۲۵ میلیون گرددشگر در سال ۲۰۰۷ افزایش یافته است که متوسط نرخ رشد سالانه آن حدود ۶/۵ درصد می‌باشد. همچنین، درآمد جهانی حاصل از گرددشگری بیش از ۸۰۰ میلیارد دلار در سال ۲۰۰۷ برآورد شده است که در مقایسه با ۱۰۶/۵ میلیارد دلار در سال ۱۹۸۰ و ۲۷۳/۲ میلیارد دلار در سال ۱۹۹۰، از نرخ رشد متوسط سالانه حدود ۷ درصد طی سال‌های ۱۹۸۰ تا ۲۰۰۷ برخوردار بوده است (سیستان‌آه<sup>۱</sup>، ۲۰۱۱). در سال ۲۰۱۱، صنعت گرددشگری حدود ۹ درصد از تولید ناخالص داخلی جهانی را به خود اختصاص داده است که این امر همراه با ایجاد ۲۵۵ میلیون شغل بوده است. برای ده سال آینده پیش‌بینی می‌شود که این صنعت دارای نرخ رشد سالانه ۴ درصد باشد که این امر ۱۰ درصد از تولید ناخالص داخلی جهانی را به خود اختصاص می‌دهد (چو<sup>۲</sup>، ۲۰۱۳).

صنعت گرددشگری در بهبود رشد اقتصادی، ایجاد اشتغال و افزایش درآمد برای دولت نقش مهمی را ایفا می‌نماید. در حقیقت، نظریه گرددشگری منجر به رشد<sup>۳</sup> بیان می‌کند که گرددشگری جهانی را می‌توان به عنوان یک عامل راهبردی بالقوه برای رشد اقتصادی در نظر گرفت. افزون بر این، مخارج انجام‌شده توسط گرددشگران نوعی صادرات تلقی می‌گردد که موجب به دست آوردن ارز خارجی و بهبود تراز تجاری می‌شود. بنابراین، دریافتی‌های حاصل از توسعه گرددشگری را می‌توان به عنوان یک منبع مهم درآمدی برای اقتصاد ملی در نظر گرفت. همچنین از درآمدهای ارزی حاصل از صنعت گرددشگری می‌توان برای واردات کالاهای سرمایه‌ای جهت تولید کالاهای و خدمات استفاده نمود (سیستان‌آه، ۲۰۱۱). بنابراین، رشد سریع گرددشگری از طریق اثرات تکاثری باعث افزایش درآمد خانوارها، افزایش دریافتی‌های دولت، بهبود تراز تجاری، افزایش درآمدهای مالیاتی و ایجاد اشتغال

<sup>1</sup> Seetanah

<sup>2</sup> Chou

<sup>3</sup> Tourism-Led Economic Growth (TLEG)

می شود (سیستان، ۱۳۹۰؛ چو، ۲۰۱۱). از این رو، نظریه های اقتصادی بیان می کنند که توسعه گردشگری تأثیر مثبتی بر رشد اقتصادی دارد. اما، برخی محققان اعتقاد دارند که در عالم واقع این امر صادق نمی باشد و رشد اقتصادی دلیل توسعه گردشگری است. مطابق با این دیدگاه، سرمایه گذاری در صنایع پیشرو از اولویت بالاتری در مقایسه با صنعت گردشگری برخوردار است. لذا، این سؤال برای سیاستگذاران مطرح می گردد که برای توسعه صنعت گردشگری، آیا بهتر است سرمایه گذاری مستقیم در این صنعت انجام شود و یا این که با رشد اقتصادی و توسعه زیرساخت ها، شرایط لازم برای جذب و ورود گردشگران فرآهم آورد؟ در این مطالعه برای پاسخگویی به این سؤال، از دو روش VAR و آزمون علی دومیترسکو- هورلین<sup>۴</sup> استفاده شده است که وجه تمایز این مطالعه نسبت به مطالعات پیشین است. در نظر گرفتن ناهمگنی و انعطاف پذیری بسیار بالا از ویژگی های منحصر به فرد روش های مذکور است. این مطالعه بخش های مختلفی را شامل می شود. پس از بررسی ادبیات موضوع، مواد و روش ها بیان می گردد. در قسمت نتایج و بحث، نتایج برآورده، گزارش و تفسیر می شود و سرانجام بر اساس یافته های مطالعه، نتیجه گیری و پیشنهادات سیاستی ارائه می گردد.

## ۲- ادبیات موضوع

رابطه میان گردشگری و رشد اقتصادی از اهمیت ویژه ای برخوردار است، به طوری که اتخاذ استراتژی های مناسب گردشگری مورد توجه سیاستگذاران اغلب کشورها است. زیرا صنعت گردشگری در کنار صنایع مهم دیگر، اثر قابل توجهی بر رفاه جامعه دارد (ریچی<sup>۵</sup>، ۱۹۹۳). از این رو طی چند دهه اخیر، بسیاری از محققان به بررسی رابطه میان مخارج گردشگری و رشد اقتصادی پرداخته اند. لenza و همکاران<sup>۶</sup> (۲۰۰۳) طی مطالعه ای به بررسی آثار بلندمدت گردشگری بر اقتصاد عضو سازمان همکاری اقتصادی و توسعه<sup>۷</sup> پرداختند. با به کار گیری سیستم تقاضای تقریباً ایده آل<sup>۸</sup>، نتایج مطالعه طی دوره‌ی ۱۹۷۵-۱۹۹۲ نشان داد که گردشگری اثر

<sup>4</sup> Dumitrescu-Hurlin

<sup>5</sup> Ritchie

<sup>6</sup> Lanza *et al.*

<sup>7</sup> Organisation for Economic Co-operation and Development (OECD)

<sup>8</sup> Almost Ideal Demand System (AIDS)

مثبتی بر رشد اقتصادی کشورهای مورد مطالعه دارد. دریتسکیس<sup>۹</sup> (۲۰۰۴) طی مطالعه‌ای به بررسی تأثیر گردشگری بر رشد اقتصادی بلندمدت یونان پرداخت. وی با استفاده از داده‌های فصلی طی دوره‌ی (۱۹۶۰-۲۰۰۰) و با به کارگیری آزمون علیت گرنجر به این نتیجه دست یافت که یک رابطه علیٰ دو طرفه میان گردشگری و رشد اقتصادی وجود دارد. سکریت و هایبرس<sup>۱۰</sup> (۲۰۰۵) در مطالعه‌ای اثر گردشگری بر توسعه اقتصادی ۳۷ کشور در حال توسعه طی دوره‌ی ۱۹۹۲-۱۹۶۵ را مورد بررسی قرار دادند. نتایج مطالعه آن‌ها با استفاده از روش حداقل مربعات معمولی نشان داد که توسعه اقتصادی به طور مثبتی تحت تأثیر گردشگری قرار می‌گیرد. پو و هانگ<sup>۱۱</sup> (۲۰۰۸) در مطالعه‌ای به بررسی اثر توسعه گردشگری بر رشد اقتصادی برای ۸۸ کشور طی دوره‌ی ۱۹۹۵-۲۰۰۵ پرداختند. نتایج مطالعه با استفاده از مدل خودرگرسیون آستانه<sup>۱۲</sup> نشان داد که اگر سهم دریافتی‌های حاصل از گردشگری به تولید ناخالص داخلی کمتر از ۴/۰۴ یا بیشتر از ۴/۷۳ درصد باشد، گردشگری اثر مثبت و معنی‌داری بر رشد اقتصادی خواهد داشت. لی و چین<sup>۱۳</sup> (۲۰۰۸) در مطالعه‌ای شکسته‌های ساختاری، توسعه صنعت گردشگری و رشد اقتصادی کشور تایوان را مورد بررسی قرار دادند. نتایج مطالعه آن‌ها با استفاده از داده‌های سالانه طی دوره‌ی ۱۹۵۹-۲۰۰۳ و روش روش همجمعی جوهانسون و جوسیلیوس نشان داد که رابطه علیٰ میان گردشگری و رشد اقتصادی دو طرفه می‌باشد. نووسیکیرا و مکاس‌نونس<sup>۱۴</sup> (۲۰۰۸) در مطالعه‌ای به بررسی اثر گردشگری بر رشد اقتصادی ۹۴ کشور پرداختند. نتایج مطالعه با استفاده از داده‌های تابلویی طی دوره‌ی ۱۹۸۰-۲۰۰۲ و با به کارگیری روش اثرات ثابت<sup>۱۵</sup> و گشتاروهای تعمیم یافته<sup>۱۶</sup> نشان داد که گردشگری از تعیین‌کننده‌های مثبت رشد اقتصادی است. اوزترک و علی<sup>۱۷</sup> (۲۰۰۹) طی مطالعه‌ای به بررسی رابطه علیٰ میان رشد گردشگری و رشد اقتصادی ترکیه طی دوره‌ی ۱۹۷۰-۲۰۰۷ پرداختند. با به

<sup>9</sup> Dritsakis<sup>10</sup> Skerrit and Huybers<sup>11</sup> Po and Huang<sup>12</sup> Threshold Autoregressive<sup>13</sup> Lee and Chien<sup>14</sup> Neves Sequeira and Macas Nunes<sup>15</sup> Fixed Effects (FE)<sup>16</sup> Generalized Method of Moments (GMM)<sup>17</sup> Ozturk and Ali

کارگیری روش خود رگرسیون با وقفه توزیعی<sup>۱۸</sup>، نتایج مطالعه نشان داد که رابطه‌ای میان توسعه گردشگری و رشد اقتصادی ترکیه طی دوره‌ی مورد مطالعه وجود ندارد. چن و چیو-وی<sup>۱۹</sup> (۲۰۰۹) در مطالعه‌ای به بررسی رابطه علی میان گسترش گردشگری و رشد اقتصادی در دو کشور تایوان و کره جنوبی پرداختند. آن‌ها با استفاده از داده‌های فصلی طی دوره‌ی (۱۹۷۵-۲۰۰۷) و مدل EGARCH-M با عوامل ناطمینانی به این نتیجه دست یافتند که نظریه گردشگری منجر به رشد برای کشور تایوان برقرار است، در حالی که برای کشور کره جنوبی رابطه علی دو طرفه به دست آمد. خلیل و همکاران<sup>۲۰</sup> (۲۰۱۰) در مطالعه‌ای به بررسی رابطه علی میان دریافتی‌های گردشگری و رشد اقتصادی در کشور پاکستان طی دوره‌ی ۱۹۶۰-۲۰۰۵ پرداختند. با استفاده از روش همجمعی جوهانسون<sup>۲۱</sup> نتایج مطالعه بیانگر وجود یک رابطه علی دو طرفه میان گردشگری و رشد اقتصادی در پاکستان می‌باشد. تانگ<sup>۲۲</sup> (۲۰۱۱) در مطالعه‌ای صحت نظریه گردشگری منجر به رشد را برای ۱۲ بازار مختلف گردشگری تایلند مورد آزمون قرار داد، وی با استفاده از داده‌های ماهانه طی دوره‌ی (۱۹۹۵-۲۰۰۹) و با به کارگیری آزمون علیت گرنجر به این نتیجه دست یافت که طی دوره‌ی بلندمدت نظریه مذکور تنها در ۵ بازار گردشگری تایلند معتبر می‌باشد. جلیل و همکاران<sup>۲۳</sup> (۲۰۱۳) طی مطالعه‌ای به بررسی ارتباط بلندمدت میان گردشگری و رشد اقتصادی پاکستان طی دوره‌ی ۱۹۷۲-۲۰۱۱ پرداختند. نتایج مطالعه آن‌ها با استفاده از روش خود رگرسیون با وقفه توزیعی نشان داد که گردشگری اثر مثبت و معنی‌داری بر رشد اقتصادی پاکستان دارد. چتزاپانتونیو و همکاران<sup>۲۴</sup> (۲۰۱۳) در مطالعه‌ای با استفاده از داده‌های ماهانه طی دوره‌ی (۲۰۱۰-۲۰۱۲) به بررسی رابطه میان گردشگری و رشد اقتصادی برای چهار کشور فرانسه، ایتالیا، اسپانیا و یونان پرداختند. آن‌ها با به کارگیری الگوی ساختاری VAR به این نتیجه دست یافتند که یک رابطه علی یک طرفه از رشد اقتصادی به سمت توسعه

<sup>18</sup> Autoregressive Distributed Lag (ARDL)<sup>19</sup> Chen and Chiou-Wei<sup>20</sup> Khalil *et al.*<sup>21</sup> Johansen co-integration<sup>22</sup> Tang<sup>23</sup> Jalil *et al.*<sup>24</sup> Chatziantoniou *et al.*

گرددشگری وجود دارد. چو (۲۰۱۳) در مطالعه‌ای به بررسی روابط علی میان مخارج گرددشگری و رشد اقتصادی پرداخت. وی با استفاده از داده‌های تابلویی مربوط به ده کشور در حال گذر<sup>۲۵</sup> طی دوره ۱۹۸۸-۲۰۱۱ به این نتیجه دست یافت که عوامل مختلفی می‌توانند بر جهت علیت میان توسعه گرددشگری و رشد اقتصادی در کشورهای مورد مطالعه تأثیرگذار باشند. لی و برهمسرین<sup>۲۶</sup> (۲۰۱۳) در مطالعه‌ای به بررسی اثر گرددشگری بر رشد اقتصادی کشورهای عضو اتحادیه اروپا پرداختند. آن‌ها با استفاده از آزمون‌های ریشه واحد و همجمعی مربوط به داده‌های تابلویی و رهیافت اثرات ثابت طی دوره‌ی ۱۹۸۸-۲۰۰۹ به این نتیجه دست یافتند که رشد گرددشگری اثر مثبت و قابل توجیهی بر رشد اقتصادی کشورهای مورد مطالعه دارد.

در مطالعات داخلی، طبی و همکاران (۱۳۸۶) به بررسی رابطه توسعه‌ی گرددشگری و رشد اقتصادی در ایران طی دوره‌ی ۱۳۳۸-۸۳ پرداختند. نتایج مطالعه آن‌ها با استفاده از الگوی علی گرنجر نشان داد که رابطه علی میان گرددشگری و رشد اقتصادی در ایران دو طرفه است. میرزایی و جلیلی (۱۳۹۰) در مطالعه‌ای به بررسی اثر توسعه گرددشگری بر رشد اقتصادی در ایران و کشورهای منتخب خاورمیانه پرداختند. نتایج برآورده مدل اثرات ثابت طی دوره زمانی ۱۹۹۵-۲۰۰۸ نشان داد که نظریه گرددشگری منجر به رشد در کشورهای مورد بررسی برقرار می‌باشد. حسنوند و خدایپناه (۱۳۹۳) در مطالعه‌ای به بررسی نظریه گرددشگری منجر به رشد در کشورهای منتخب در حال توسعه طی دوره زمانی ۲۰۱۱-۱۹۹۹ پرداختند. نتایج تخمین اثرات ثابت و گشتاورهای تعیین یافته سیستمی نشان داد که رابطه مثبتی میان توسعه گرددشگری و رشد اقتصادی در کشورهای مورد بررسی وجود دارد.

اگر چه بسیاری از محققان اعتقاد دارند که گرددشگری اثر مثبتی بر رشد اقتصادی دارد؛ اما، رابطه علی میان این دو متغیر موضوعی بحث برانگیز است و با مروری بر ادبیات موضوع می‌توان چهار نوع رابطه را مشخص نمود: (۱) رابطه علی از توسعه گرددشگری به رشد اقتصادی؛ (۲) رابطه علی از رشد اقتصادی به توسعه گرددشگری؛ (۳) رابطه علی دو طرفه میان گرددشگری و رشد اقتصادی؛ (۴) نبود

<sup>25</sup> Transition Countries

<sup>26</sup> Lee and Brahmstrene

رابطه علی میان گردشگری و رشد اقتصادی. بر این اساس، مباحث نظری مرتبط با هر یک از چهار حالت فوق، در ادامه این بخش از مطالعه توضیح داده می‌شوند. شواهدی وجود دارد که بر اساس آن می‌توان استدلال نمود که جهت علیت از توسعه گردشگری به سمت رشد اقتصادی است که این رابطه منجر به مطرح شدن نظریه گردشگری مزایای متعددی برای اقتصاد یک کشور است (لی و چین، درآمد گردشگری دارای مزایای متعددی برای اقتصاد است. بر اساس این نظریه، افزایش ۲۰۰۸). در واقع، نظریه گردشگری منجر به رشد (برگرفته از نظریه صادرات منجر به رشد) بیان می‌کند که گردشگری از چندین مسیر به رشد اقتصادی بلندمدت کمک می‌کند. مسیر اول؛ افزایش سطح درآمد است که با گسترش رقابت میان بنگاه‌های محلی و خارجی و همچنین با بهبود دانش فنی حاصل می‌شود. مسیر دوم از طریق بهبود بازدهی نسبت به مقیاس در بنگاه‌های محلی است. در مسیر سوم؛ افزایش درآمد گردشگری موجب کاهش محدودیت‌های مربوط به ارز خارجی می‌شود. بر این اساس، نظریه گردشگری منجر به رشد اقتصادی بیان می‌کند که اثر مثبت صنعت گردشگری بر بهبود تراز پرداخت‌ها از طریق افزایش درآمدهای ارزی، گسترش صادرات و در دسترس بودن سرمایه برای واردات کالاهای است، به طوری که مجموع این سه عامل اثرات مثبتی بر رشد اقتصادی خواهند داشت (سیستان، ۲۰۱۱).

این اعتقاد وجود دارد که رشد اقتصادی یک عامل ضروری برای افزایش درآمدهای حاصل از گردشگری است که این نظریه تحت عنوان رشد گردشگری با محوریت اقتصادی<sup>۲۷</sup> شناخته می‌شود. این نظریه با این استدلال مطرح می‌شود که هرگونه طرح سیاسی با هدف بهبود توسعه اقتصادی باید مقدم بر سیاست‌هایی باشد که به طور مستقیم باعث افزایش رشد گردشگری می‌شوند. مطابق با این دیدگاه، رشد اقتصادی درنهایت منجر به توسعه صنعت گردشگری می‌شود (چتزيانتونيو و همکاران، ۲۰۱۳). در برخی از ادبیات تجربی شواهدی وجود دارد که بر مبنای آن رابطه علی دو طرفه میان گردشگری و رشد اقتصادی وجود دارد. وجود رابطه علی دو طرفه میان گردشگری و رشد اقتصادی نمایانگر آن است که سطح فعالیت‌های اقتصادی و توسعه صنعت گردشگری اثرات متقابلی بر یکدیگر

<sup>27</sup> Economic-Driven Tourism Growth (EDTG)

دارند (لی و چین، ۲۰۰۸). برخی از محققان نیز اعتقاد دارند که هیچگونه رابطه علی میان گردشگری و رشد اقتصادی وجود ندارد (چتزيانتونیو و همکاران، ۲۰۱۳). به طور کلی در ادبیات موجود، یافته‌های متناقضی به دست آمده است و توافق نظری در مورد ارتباط میان گردشگری و رشد اقتصادی وجود ندارد. این امر به دلیل متفاوت بودن مدل‌ها و روش‌های انتخابی است. صرف نظر از چگونگی اثرگذاری این دو متغیر بر یکدیگر، این اثر پس از طی دوره‌ی زمانی مشخصی روی خواهد داد و این امر استفاده از تکنیک‌های معمول آماری را با مشکل مواجه می‌سازد. در این مطالعه برای در نظر گرفتن اثرات گذشته این دو متغیر از روش خودرگرسیون برداری<sup>۲۸</sup> در چارچوب داده‌های تابلویی استفاده می‌گردد.

### ۳- روش‌شناسی

در این مطالعه به منظور آزمون رابطه میان گردشگری و رشد اقتصادی از متغیر رشد تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی ( $y$ ) و دریافتی‌های سرانه واقعی حاصل از گردشگری ( $tu$ ) استفاده می‌گردد. این داده‌ها به صورت سالانه و از پایگاه اطلاعاتی بانک جهانی جمع‌آوری گردیده‌اند. دوره‌ی زمانی مطالعه از سال ۱۹۹۵-۲۰۱۲ است و کشورهای عضو منا به عنوان مقاصد گردشگری و کشورهای مورد مطالعه انتخاب شده‌اند. کشورهای منا در منطقه خاورمیانه و شمال آفریقا قرار دارند و ۲۱ کشور را شامل می‌گردد (الجزایر، بحرین، جیبوتی، مصر، ایران، فلسطین، عراق، اردن، کویت، لبنان، لیبی، مالت، مراکش، عمان، قطر، عربستان سعودی، رژیم اشغالگر قدس، سوریه، تونس، امارات متحده عربی و یمن). کشورهای عضو منطقه منا از فراوانی منابع طبیعی برخوردارند، به نحوی که در سطح جهانی، ۵۷ درصد درآمدهای نفتی و ۴۱ درصد منابع گاز طبیعی اختصاص به این کشورها دارد. از لحاظ گردشگری، منطقه منا به عنوان "بهشت گردشگری" شناخته می‌شود؛ زیرا، این کشورها از تمدن کهن، میراث فرهنگی غنی و مکان‌های مذهبی فراوانی برخوردار می‌باشند (تانگ و ابوسدرا<sup>۲۹</sup>، ۲۰۱۴).

استفاده از روش‌های سری‌زمانی یک رهیافت معمول برای آزمون رابطه میان گردشگری و رشد اقتصادی است، اما، این روش‌ها به دلیل نادیده گرفتن ناهمگنی

<sup>28</sup> Panel Vector Autoregression (panel VAR)

<sup>29</sup> Tang and Abosedra

موجود در داده‌ها نتایج معترضی را ارائه نمی‌دهند. لذا، برای رفع این نقیصه از روش‌هایی مبتنی بر داده‌های تابلویی استفاده می‌گردد که از این لحاظ وجه تمایز این مطالعه نسبت به مطالعات پیشین است. در ابتدا شرحی مختصر از روش panel VAR در چارچوب داده‌های تابلویی ارائه می‌گردد و سپس شکل اجمالی آزمون علیت داده‌های تابلویی توضیح داده می‌شود.

### ۱-۳- روش panel VAR

تحلیل خودگرسیون برداری یکی از روش‌هایی است که در مطالعات تجربی برای تشخیص جهت رابطه علی استفاده می‌گردد. به طور معمول، روش VAR برای داده‌های سری زمانی با تعداد زیاد دوره‌های زمانی استفاده می‌گردد. اما، از این روش می‌توان برای داده‌های تابلویی نیز استفاده نمود و لازمه‌ی استفاده از آن، در نظر گرفتن برخی مسائل اقتصادسنجی است. ابتدا آزمون علیت در چارچوب داده‌های سری زمانی مورد بررسی قرار می‌گیرد. مسئله این است که آیا رابطه علی میان متغیرهای  $x$  و  $y$  وجود دارد یا خیر. متغیر  $x$  در صورتی علت (گرنجر)  $y$  نیست که پیش‌بینی  $\hat{y}_t$  با در نظر گرفتن مقادیر گذشته  $x_t$  بهبود نیابد. این روش با تخمین رگرسیون زیر انجام می‌شود:

$$(1) \quad y_t = \gamma_0 + \sum_{l=1}^m \gamma_l y_{t-l} + \sum_{k=1}^n \alpha_k x_{t-k} + u_t$$

که  $\alpha$  و  $\delta$  پارامترهای مدل و مقادیر  $m$  و  $n$  نمایانگر تعداد وقفه‌های کافی است تا اطمینان حاصل گردد که جمله‌ی اخلال رگرسیون در رابطه (1) دارای خصوصیات مناسب آماری است. با استفاده از آزمون فرضیه مشترک  $\delta_1=\delta_2=\dots=\delta_m=0$  می‌توان مشخص نمود که آیا  $x$  علت  $y$  است یا خیر، که این امر با استفاده از آزمون F صورت می‌پذیرد. برای انجام آزمون لازم است که تعداد مشاهدات  $x$  و  $y$  به اندازه کافی وجود داشته باشد تا برآوردهای سازگاری از پارامترهای معادله‌ی (1) حاصل شود. به طور کلی در داده‌های تابلویی، تعداد مقاطع زیاد و تعداد سال‌های مورد مطالعه اندک می‌باشد. محققان برای آزمون علیت، داده‌های مربوط به واحدهای مختلف را ترکیب می‌نمایند به طوری که این روش مستلزم وارد نمودن قید یکسانی واحدهای مقطعی است. بنابراین، این روش احتمال وجود اثر فردی هر واحد مقطعی را نادیده می‌گیرد. اثر فردی نمایانگر تأثیر متغیرهای غیرقابل مشاهده

است که دارای یک اثر پایدار بر متغیر وابسته هستند. لذا در چارچوب داده‌های تابلویی فرض می‌شود که  $N$  واحد مقطعی و  $T$  دوره‌ی زمانی وجود دارد. فرض دیگر وجود یک اثر انفرادی ( $f_i$ ) برای  $i=1, \dots, N$  واحد مقطعی است. بنابراین، مدل را می‌توان به صورت زیر در نظر گرفت:

$$y_{it} = r_0 + \sum_{l=1}^m r_l y_{it-l} + \sum_{l=1}^m u_l x_{it-l} + f_i + u_{it} \quad (2)$$

استفاده از تفاضل مرتبه اول و به کارگیری روش حداقل مربعات معمولی یا تعمیم یافته یک روش استاندارد برای تخمین معادله فوق است که این امر منجر به حذف اثر انفرادی می‌گردد:

$$y_{it} - y_{it-1} = \sum_{l=1}^m r_l (y_{it-l} - y_{it-l-1}) + \sum_{l=1}^m u_l (x_{it-l} - x_{it-l-1}) + (u_{it} - u_{it-1}) \quad (3)$$

اما، استفاده از روش مذکور معتبر نمی‌باشد؛ زیرا،  $y_{it-1}$  تابعی از  $u_{it-1}$  است و جمله خطای  $(u_{it} - u_{it-1})$  با برآورد کننده  $(y_{it-1} - y_{it-2})$  همبسته می‌باشد. در واقع، تفاضل گیری می‌تواند مشکل همزمانی را ایجاد نماید. استفاده از برآورد کننده متغیرهای ابزاری یک راه حل مناسب برای مقابله با این مشکل است. اما، برای به کارگیری آن لازم است که از سبک دیگری استفاده نمود؛ زیرا، متغیرهای ابزاری در طول زمان تغییر می‌کنند. وجود تعداد مناسبی از متغیرهای ابزاری برای برآورد معادله (۳) یک معیار برای شناسایی به شمار می‌رود. یک برآورد کننده کارا طی سه مرحله حاصل می‌گردد (هولتز-ایکین و همکاران<sup>۳۰</sup>، ۱۹۸۸):

- ۱) با استفاده از 2SLS، معادلات برای هر دوره‌ی زمانی برآورد می‌شوند. اما برخلاف حالت معمول، لیست متغیرهای ابزاری برای هر معادله یکسان نمی‌باشد؛ زیرا همانگونه که عنوان شد، متغیرهای ناهمبسته با جملات خطای هر دوره تغییر می‌کنند.
- ۲) با استفاده از جملات باقیمانده و ماتریس ابزارها، کواریانس مشترک جملات خطای برآورد می‌شود.
- ۳) با استفاده از روش حداقل مربعات تعمیم یافته، تمام پارامترها به طور همزمان برآورد می‌گردند.

<sup>30</sup> Holtz-Eakin *et al.*

### ۲-۳- آزمون علیت دومیترسکو- هورلین برای داده‌های تابلویی

در استفاده از آزمون علیت برای داده‌های تابلویی باید ناهمگنی میان مقاطع را در نظر گرفت. برای این منظور، از آزمون دومیترسکو- هورلین برای مدل داده‌های تابلویی ناهمگن استفاده می‌شود. آزمون دومیترسکو- هورلین این امکان را فرآهم می‌آورد که هر دو بعد ناهمگنی (ناهمگنی روابط علی و ناهمگنی مدل رگرسیونی) مورد استفاده برای آزمون علیت گرنجر) را در نظر گرفت. برای آزمون رابطه علی در الگوی داده‌های تابلویی از مدل زیر استفاده می‌شود:

$$y_{it} = \gamma_0 + \sum_{l=1}^K \gamma_l^{(l)} y_{it-l} + \sum_{l=1}^K \gamma_l^{(l)} x_{it-l} + f_i + u_{it} \quad (4)$$

در رابطه فوق، فرض می‌شود که تعداد وقفه برای تمام واحدهای مقطعی یکسان می‌باشد و پارامترهای خودرگرسیون  $\gamma_l^{(l)}$  و ضرایب شیب  $\gamma_l^{(l)}$  در میان مقاطع متفاوت در نظر گرفته می‌شوند. در چارچوب تحلیل سریزمانی، آزمون علیت استاندارد مشتمل بر آزمون محدودیت‌های خطی بر بردار ضرایب  $\delta_i$  است که در مدل داده‌های تابلویی باید مسئله ناهمگنی میان مقاطع را نیز در نظر گرفت. اثرات فردی  $f_i$  منشأ اولیه ناهمگنی است و منشأ دیگر مربوط به ناهمگنی ضرایب شیب  $\delta_i$  است. در این راستا، برای در نظر گرفتن هر دو بعد ناهمگنی از آزمون دومیترسکو- هورلین استفاده می‌گردد که فرضیه صفر آن برای تمام نها به صورت زیر تعریف می‌شود:

$$H_0: \delta_i = 0 \quad i=1, \dots, N \quad (5)$$

تحت فرضیه مقابل (مدل ناهمگن)، دو زیر گروه از واحدهای مقطعی وجود دارد: زیر گروه اول توسط روابط علی از  $x$  به  $y$  توصیف می‌شوند و زیر گروه دیگر شامل روابط غیر علی از  $x$  به  $y$  است. لذا فرضیه مقابل را می‌توان به صورت زیر بیان نمود:

$$\begin{array}{ll} H_1: \delta_i = 0 & i=1, \dots, N_1 \\ \delta_i \neq 0 & i=N_1+1, N_1+2, \dots, N \end{array} \quad (6)$$

که نسبت  $N_1/N$  در رابطه فوق کمتر از یک می‌باشد. زیرا اگر  $N_1=N$  باشد، آن‌گاه، رابطه علی برای هیچ یک از مقاطع در مدل داده‌های تابلویی وجود ندارد. در حالت دیگر، اگر  $N_1=0$  باشد؛ آن‌گاه، رابطه علی از  $x$  به  $y$  برای تمام مقاطع نمونه برقرار می‌باشد (دومیترسکو و هورلین، ۲۰۱۲).

#### ۴- نتایج و بحث

پیش از انجام آزمون علیّت باید ایستایی متغیرهای مطالعه مورد بررسی قرار گیرد. برای داده‌های تابلویی در سطح کلان (برای مثال، در سطح کشوری) به طور معمول فرض می‌شود که تعداد مقاطع ثابت و تعداد دوره‌های زمانی به سمت بی‌نهایت میل می‌نماید و با توجه به این مسأله لازم است که آزمون ریشه واحد مناسب انتخاب گردد. با توجه به خصوصیات مجانبی آزمون لوین، لین و چو (LLC)، در این مطالعه از این آزمون برای بررسی ایستایی استفاده می‌گردد که نتایج آن در جدول (۱) گزارش شده است. بر اساس نتایج جدول (۱) فرض صفر مبنی بر وجود ریشه واحد را می‌توان رد کرد و لذا متغیرهای مطالعه در سطح ایستا می‌باشند.

**جدول ۱: نتایج آزمون ریشه واحد LLC**

نام متغیر	مقدار آماره آزمون	ارزش احتمال
لگاریتم رشد تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی	-۲/۱۲۸۸	.۰/۰۱۶۶
لگاریتم دریافتی‌های سرانه واقعی حاصل از گردشگری	-۴/۱۲۱۶	.۰/۰۰۰۰

مأخذ: محاسبات تحقیق

پس از تأیید ایستایی متغیرهای مطالعه، از روش VAR در چارچوب داده‌های تابلویی برای تعیین جهت رابطه علیّی میان گردشگری و رشد اقتصادی استفاده می‌گردد. در استفاده از روش VAR، تمام پارامترهای مدل، از جمله اثر انفرادی، تابعی از زمان در نظر گرفته می‌شوند. همچنین برای کنترل اثرات متغیرهای کلان اقتصادی در هر سال، از متغیرهای دامی زمانی در تصریح الگوی VAR استفاده می‌شود. در انتخاب وقفه‌های مدل، روش پیشنهادی هولتز-ایکین و همکاران (۱۹۸۸) به کار گرفته شده است که بر اساس آن، تفاوت مجموع مربعات خطای مدل‌های مقید و غیرمقید ملاک انتخاب وقفه‌های بهینه می‌باشد. با در نظر گرفتن این مشخصه، تنها یک وقفه از متغیرهای سمت راست وارد الگوی برآورده شده است. همچنین متغیرهای دامی زمانی و وقفه‌های دو متغیر رشد اقتصادی و گردشگری به عنوان متغیرهای ابزاری در نظر گرفته شده‌اند. یکی از ویژگی‌های مدل VAR تابلویی، انعطاف‌پذیری بسیار بالای آن است به نحوی که در آزمون علیّت مشابه با روش گرنجر عمل می‌نماید، با این تفاوت که در روش VAR تابلویی می‌توان آزمون معنی‌داری بلوکی را نیز انجام داد. با توجه به موارد مطرح شده،

نتایج برآورده به روش VAR تابلویی در جدول (۲) گزارش شده است. مقدار آماره  $J$  در جدول (۲) مؤید آن است که متغیرهای ابزاری به کار رفته معتبر (برونزا) هستند که این مسأله بیانگر تصریح مناسب الگوی panel VAR است. همانگونه در جدول (۲) مشاهده می‌شود، رشد تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی به طور مثبت و معنی‌داری تحت تأثیر مقدار گذشته‌ی خود قرار می‌گیرد، در حالی که متغیر دریافتی‌های سرانه واقعی گردشگری اثر معنی‌داری بر رشد اقتصادی کشورهای عضو منطقه‌ی منا ندارد. همچنین، نتایج جدول (۲) نشان می‌دهد که وقفه‌ی متغیر گردشگری اثر مثبت و معنی‌داری بر مقدار جاری این متغیر دارد. از سوی دیگر، متغیر رشد تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی به طور مثبت و معنی‌داری بر میزان گردشگری اثرگذار است. در مجموع نتایج جدول (۲) حاکی از آن است که نظریه رشد گردشگری با محوریت اقتصادی در کشورهای عضو منطقه‌ی منا برقرار می‌باشد.

جدول ۲: نتایج برآورده به روش Panel-VAR

معادله رشد اقتصادی				
ارزش احتمال	آماره $t$	انحراف معیار	ضریب برآورده	متغیر
۰/۰۰۰۰	۹/۳۸۶۰	۰/۰۶۸۰	۰/۶۳۸۴	لگاریتم رشد تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی با یک وقفه
۰/۲۹۵۸	۱/۰۴۵۳	۰/۰۰۵۷	۰/۰۰۶۰	لگاریتم دریافتی‌های سرانه واقعی گردشگری
مجموع مربعات خط: ۰/۴۹۴۱				آماره دوربین واتسون: ۲/۲۸۸۲
معادله گردشگری				
ارزش احتمال	آماره $t$	انحراف معیار	ضریب برآورده	متغیر
۰/۰۰۰۰	۳/۹۳۴۸	۰/۴۴۸۸	۱/۷۶۶۲	لگاریتم رشد تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی
۰/۰۰۰۵	۳/۴۳۲۶	۰/۱۰۲۶	۰/۳۵۲۳	لگاریتم دریافتی‌های سرانه واقعی گردشگری با یک وقفه
مجموع مربعات خط: ۵۶/۵۰۹۱				آماره دوربین واتسون: ۱/۹۵۷۲
ارزش احتمال $J$ : ۰/۱۱۸۶				مقدار آماره $J$ : ۷۳/۱۴۴۴

مأخذ: محاسبات تحقیق

برای اطمینان از صحت نتایج به دست آمده، علاوه بر روش Panel-VAR، از آزمون علیت دومیترسکو-هولین نیز استفاده می‌گردد. آزمون علیت دومیترسکو-هولین فرض می‌کند که تمام ضرایب میان کشورها متفاوت می‌باشند. آماره آزمون با اجرای رگرسیون استاندارد علیت گنجر برای هر مقطع به صورت انفرادی

محاسبه می‌شود. در این آزمون، متوسط آماره‌های آزمون محاسبه می‌شود که تحت عنوان آماره  $Z$  شناخته می‌شود. آماره  $Z$  برای داده‌های تابلویی نامتوازن است که دارای توزیع نرمال استاندارد است. بر این اساس، نتایج آزمون دومیترسکو- هورلین در جدول (۳) گزارش شده است.

جدول ۳: نتایج آزمون علیت دومیترسکو- هورلین

فرض صفر	آماره $W$	آماره $Z$	ارزش احتمال
گردشگری به طور همگنی علت رشد اقتصادی نمی‌باشد.	۳/۵۴۶۸۵	۱/۶۸۶۷۰	۰/۰۹۱۷
رشد اقتصادی به طور همگنی علت گردشگری نمی‌باشد.	۳/۷۵۰۵۰	۲/۰۰۴۸۸	۰/۰۴۵۰

مأخذ: محاسبات تحقیق

نتایج جدول (۳) مؤید آن است که رابطه علی میان گردشگری و رشد اقتصادی یک طرفه می‌باشد و جهت علیت از رشد اقتصادی به سمت گردشگری است. لذا مشابه با روش panel VAR می‌توان استدلال نمود که نظریه رشد گردشگری با محوریت اقتصادی در کشورهای عضو منطقه منا برقرار است. نظریه رشد اقتصادی با محوریت اقتصادی مؤید آن است که رشد گردشگری یک کشور از طریق شرایط مساعد اقتصادی تحقق می‌پذیرد. در واقع، فرآهم آوردن یک جو اقتصادی مثبت، موجب تشویق فعالیت‌های گردشگری می‌شود (انتونکاکیس و همکاران<sup>۳۱</sup>). تخصیص منابع اقتصادی به صنایع پیشرو یک رویکرد مؤثر برای بهبود شرایط اقتصادی است. با اجرای این سیاست، گردشگری (به عنوان یک محصول فرعی) رشد و توسعه می‌یابد (کیم و چن<sup>۳۲</sup>، ۲۰۰۶). در واقع، تخصیص منابع اقتصادی به صنایع پیشرو (به جای صنعت سیاحت و گردشگری) موجب می‌شود که صنعت گردشگری به نوبه خود از رشد کلی اقتصاد منتفع گردد (چن و چیو- وی، ۲۰۰۹). از سوی دیگر، شواهد موجود نشان می‌دهد که در زمان کسری بودجه، دولتها برای کاهش این شکاف بودجه و تخفیف اثرات نامطلوب اقتصادی سعی می‌نمایند که فعالیت‌ها و مخارج گردشگری را کاهش دهند (به علت محدودیت بودجه‌ای و زیرساخت‌ها). بنابراین، شرایط نامطلوب اقتصادی یک مانع برای توسعه گردشگری است(انتونکاکیس و همکاران، ۲۰۱۵). از لحاظ تجربی، وجود رابطه علی از رشد

<sup>31</sup> Antonakakis *et al.*<sup>32</sup> Kim and Chen

اقتصادی به سمت توسعه گردشگری مؤبد نتایج مطالعات پیشین است (برای مثال؛ نارایان<sup>۳۳</sup>، اوه<sup>۳۴</sup>، ۲۰۰۵؛ کتیرسیو گلو<sup>۳۵</sup>، ۲۰۰۹).

## ۵- خلاصه و نتیجه گیری

صنعت گردشگری در کشورهای عضو منطقه منا نقش قابل ملاحظه‌ای در توسعه اقتصادی این کشورها ایفا می‌نماید، به نحوی که مخارج انجام شده توسط گردشگران موجب حصول ارز خارجی می‌شود. از این رو، گردشگری را می‌توان نوعی صادرات تلقی نمود. بنابراین، این گونه استدلال می‌شود که گردشگری نقش صادرات را ایفا می‌نماید که درنهایت موجب بهبود تراز تجاری و رشد اقتصادی می‌گردد. اما با وجود مطرح شدن نظریه صادرات منجر به رشد اقتصادی، شواهد تجربی بسیاری در رد این نظریه حاصل شده است. با توجه به اهمیت صنعت گردشگری در کشورهای عضو منطقه منا، این سؤال مطرح می‌گردد که آیا این صنعت موجب رشد اقتصادی این کشورها می‌گردد یا خیر؟ لذا، هدف اصلی این مطالعه بررسی رابطه علی میان گردشگری و رشد اقتصادی در کشورهای عضو منطقه منا طی دوره ۱۹۹۵-۲۰۱۲ است. با توجه به وجود ناهمگنی میان کشورها، در این مطالعه از دو روش Panel VAR و آزمون علیت دومیترسکو-هورلین در چارچوب داده‌های تابلویی استفاده شده است. نتایج دو روش مذکور نشان داد که نظریه رشد گردشگری با محوریت اقتصادی در کشورهای عضو منطقه منا برقرار است. لذا، برای رشد صنعت گردشگری در کشورهای عضو منطقه منا نیاز به اجرای سیاست‌های شتاب‌دهنده رشد اقتصادی است. از سوی دیگر، شرایط نامطلوب اقتصادی می‌تواند یک مانع برای توسعه صنعت گردشگری باشد. در این شرایط، کاهش اثرات منفی شرایط اقتصادی بر صنعت گردشگری یک راهکار سیاستی مناسب به شمار می‌رود که این امر با مدیریت مؤثر هزینه در فعالیت‌های اقتصادی تحقق می‌پذیرد.

<sup>33</sup> Narayan

<sup>34</sup> Oh

<sup>35</sup> Katircioglu

## فهرست منابع:

حسنوند، سمیه و مسعود خداپناه. (۱۳۹۳). تأثیر گردشگری بر رشد اقتصادی در کشورهای در حال توسعه: دو رویکرد پانل ایستا و پانل پویا. *فصلنامه سیاست‌های راهبردی و کلان*، ۲، ۶: ۸۷-۱۰۲.

طیبی، سیدکمیل، روح‌الله، بابکی و امیر جباری. (۱۳۸۶). بررسی رابطه توسعه گردشگری و رشد اقتصادی در ایران (۱۳۳۸-۱۳۸۳). *پژوهشنامه علوم انسانی و اجتماعی*، ۷، ۲۶: ۱۱۰-۸۳.

میرزایی، حسین و ساناز جلیلی. (۱۳۹۰). تأثیر توسعه گردشگری بر رشد اقتصادی (مقایسه ایران و کشورهای منتخب). *علوم اقتصادی*، ۵، ۱۵: ۹۱-۷۲.

Antonakakis, N., M. Dragouni, & G. Filis. (2015). How strong is the linkage between tourism and economic growth in Europe?. *Economic Modelling*, 44: 142-155.

Chatziantoniou, I., G. Filis, B. Eeckels, & A. Apostolakis. (2013). Oil prices, tourism income and economic growth: A structural VAR approach for European Mediterranean countries. *Tourism Management*, 36: 331-341.

Chen, C-F. & S-Z. Chiou-Wei. (2009). Tourism expansion, tourism uncertainty and economic growth: New evidence from Taiwan and Korea. *Tourism Management*, 30(6): 812-818.

Chou, M.C. (2013). Does tourism development promote economic growth in transition countries? A panel data analysis. *Economic Modelling*, 33: 226-232.

Dritsakis, N. (2004). Tourism as a long-run economic growth factor: an empirical investigation for Greece using causality analysis. *Tourism Economics*, 10(3): 305-316.

Dumitrescu, E. & C. Hurlin. (2012). Testing for granger non-causality in heterogeneous panels. *Economic Modelling*, 29(4): 1450-1460.

Holtz-Eakin, D., W.K. Newey, & H.S. Rosen. (1989). The revenues-expenditures nexus: evidence from local government data. *International Economic Review*, 30(2): 415-429.

- Jalil, A., T. Mahmood, & M. Idrees. (2013). Tourism-growth nexus in Pakistan: Evidence from ARDL bounds tests. *Economic Modelling*, 35:185-191.
- Katircioglu, S. (2009). Tourism, trade and growth: the case of Cyprus. *Applied Economics*, 41(2): 2741-2750.
- Khalil, S., M.K. Kakar, & A. Malik. (2007). Role of Tourism in Economic Growth: Empirical Evidence from Pakistan Economy. *The Pakistan Development Review*, 46(4): 985-995.
- Kim, H.J., & M.H. Chen. (2006). Tourism expansion and economic development: the case of Taiwan. *Tourism Management*, 27(5): 925-933.
- Lanza, A., P. Temple, & G. Urga. (2003). The implications of tourism specialisation in the long run: an econometric analysis for 13 OECD economies. *Tourism Management*, 24(3): 315-321.
- Lee, C-C. & M-S. Chien. (2008). Structural breaks, tourism development, and economic growth: Evidence from Taiwan. *Mathematics and Computers in Simulation*, 77(4): 358-368.
- Lee, J.W. & T. Brahmashrene. (2013). Investigating the influence of tourism on economic growth and carbon emissions: Evidence from panel analysis of the European Union. *Tourism Management*, 38: 69-76.
- Narayan, P.K. (2002). A tourism demand model for Fiji, 1970-2000. *Pacific Economic Bulletin*, 17(2): 103-116.
- Oh, C-O. (2005). The contribution of tourism development to economic growth in the Korean economy. *Tourism Management*, 26(1): 39-44.
- Ozturk, I. & A. Acaravci. (2009). On the causality between tourism growth and economic growth: empirical evidence from Turkey. *Transylvanian Review of Administrative Sciences*, 25, 73-81.
- Po, W-C. & B-N. Huang. (2008). Tourism development and economic growth—a nonlinear approach. *Physica A: Statistical Mechanics and its Applications*, 387(22): 5535-5542.
- Ritchie, J. B. (1993). Crafting a destination vision: Putting the concept of resident responsive tourism into practice. *Tourism management*, 14(5): 379-389.

Seetanah, B. (2011). Assessing the dynamic economic impact of tourism for island economies. *Annals of Tourism Research*, 38(1): 291-308.

Sequeira, T.N. & P. Macas Nunes. (2008). Does tourism influence economic growth? A dynamic panel data approach. *Applied Economics*, 40(18): 2431-2441.

Tang, C.F. & S. Abosedra. (2014). The impacts of tourism, energy consumption and political instability on economic growth in the MENA countries. *Energy Policy*, 68: 458-464.

Tang, C.F. (2011). Is the tourism-led growth hypothesis valid for Malaysia? a view from disaggregated tourism markets. *International Journal of Tourism Research*, 13(1): 97-101.

Archive of SID