



## بررسی سناریوهای آینده اقتصاد ایران و اثرات امنیتی آن: رویکرد عدم قطعیت بحرانی

حسین اسماعیلی رزی

دکتری اقتصاد دانشگاه اصفهان - استادیار موسسه آموزش عالی غیر انتفاعی هشت بهشت اصفهان، (نویسنده مسئول)  
h.esmaeilir@gmail.com

علیرضا نصر اصفهانی

دانشجوی دکتری آینده پژوهی مرکز تحقیقات سیاست علمی کشور

تاریخ پذیرش: ۹۶/۱۲/۱۴

تاریخ دریافت: ۹۶/۰۵/۰۷

### چکیده

مطالعه و برنامه‌ریزی برای دستیابی به آینده اقتصادی بهتر جایگاه مهمی در تفکرات سیاست‌گذاران اقتصادی هر کشور از جمله ایران دارد. اما دستیابی به آینده مطلوب و پایدار اقتصادی نیازمند پاسخ به این سوالات است که گذشته اقتصاد ایران از طریق چه عوامل و سیاست‌هایی تحت تاثیر قرار گرفته است؟ و یا چه عواملی مسیر آینده اقتصاد ایران را تعیین می‌کنند؟ بر این اساس مطالعه روندهای گذشته اقتصاد ایران و شناسایی برخی از عوامل تاثیرگذار بر آینده اقتصادی ایران با هدف نگارش سناریوهای اقتصاد ایران و اثرات امنیتی این سناریوها در افق زمانی ۵ ساله مورد توجه قرار گرفت. به این منظور، از روش سناریونگاری با رویکرد عدم قطعیت بحرانی استفاده شد. جهت تدوین سناریوهای آینده اقتصاد ایران، نیروهای پیشران دارای عدم قطعیت بحرانی با استفاده از پرسشنامه‌های تکمیل شده توسط خبرگان اقتصادی شناسایی شدند. بر این اساس، دو عدم قطعیت تحریم‌های اقتصادی بین‌المللی و قیمت نفت به عنوان عدم قطعیت‌های بحرانی اقتصاد ایران انتخاب شدند تا از تلاقی حالت‌های حدی این دو عدم قطعیت چهار فضای سناریویی از آینده اقتصاد ایران ایجاد شود.

بر اساس نتایج حاصل از نگارش این سناریوها، اقتصاد ایران در سه سناریو و با شدت و ضعف با کاهش رشد اقتصاد در آینده روبرو خواهد شد و تنها در یک سناریو شرایط رشد و توسعه اقتصادی بدون وجود مانع جدی فراهم می‌شود. از نقطه نظر امنیتی نیز در سه سناریو ذکر شده و به تبع تغییرات صورت گرفته در اقتصاد، ایران با مشکلات امنیتی با منبع منطقه‌ای، فرامنطقه‌ای و داخلی روبرو خواهد شد.

واژه‌های کلیدی: قیمت نفت، تحریم‌های اقتصادی، عدم قطعیت بحرانی، سناریو.

## ۱- مقدمه

در قرن‌های ۱۸ و ۱۹ میلادی، برنامه ریزی برای آینده اقتصاد با استفاده از برنامه‌های توسعه، تا حدود زیادی منحصر به گروه کوچکی از کشورهای جهان بوده است. اما این مفهوم و کارکردهای آن در دهه‌های بعد به تدریج به سایر نقاط جهان گسترش یافته و در حال حاضر به موضوعی مهم برای تمام کشورهای دنیا تبدیل شده است. جمهوری اسلامی ایران نیز از این قاعده مستثنی نبوده و مطالعه و برنامه‌ریزی برای دستیابی به آینده اقتصادی بهتر جایگاه مهمی در تفکرات سیاست‌گذاران آن دارد. دستیابی به آینده مطلوب و پایدار اقتصادی نیازمند مطالعه و شناسایی عوامل تاثیرگذار بر گذشته اقتصادی ایران است. چرا که دلایل پیشرفت یا عدم پیشرفت اقتصاد ایران در دوره‌های زمانی مختلف را آشکار نموده و از این رهگذر امکان دستیابی به عوامل شکل دهنده آینده اقتصاد ایران و همچنین برخی از آینده‌های محتمل آن نیز وجود دارد. علاوه بر این، شناسایی آینده‌های محتمل اقتصادی می‌تواند برخی از پیامدهای امنیتی حاصل از آن را نیز آشکار سازد و از این طریق نهادهای نظامی می‌توانند با آمادگی و آگاهی بیشتر به استقبال این آینده‌های اقتصادی و امنیتی محتمل بروند.

بر این اساس، می‌توان مطالعه روندهای گذشته اقتصاد ایران و شناسایی عوامل کلیدی تاثیرگذار بر گذشته و آینده آن با هدف شناسایی برخی از آینده‌های ممکن اقتصادی ایران و بررسی اثرات امنیتی تابع آن را مساله مطرح در این پژوهش عنوان نمود. برای پاسخ به این مساله و با توجه به ناشناخته بودن آینده، از روش تحقیق آینده پژوهانه استفاده می‌شود. آینده‌پژوهی به حدس‌ها و فرضیه‌هایی در خصوص تحولات آینده در حوزه‌های مختلف علوم گفته می‌شود که به نوعی همچون چراغ راهنما عمل می‌کنند و مسیر مطالعات و تحولات را در چارچوب حدس‌های صورت گرفته سامان می‌دهند. آینده پژوهی در واقع یک نوع رویکرد تاریخی است، با این تفاوت که در آن از قطعیت اجتناب می‌شود و تحولات آینده در قالب سناریوها و حدس‌های مختلف پیش‌بینی می‌شود. بنابراین در ادامه و ضمن شناسایی مهم‌ترین عوامل تاثیرگذار بر آینده اقتصاد ایران و عدم

قطعیت مترتب بر آن‌ها به کمک مطالعه روندهای گذشته اقتصاد ایران، برخی از سناریوهای محتمل آینده اقتصاد ایران با استفاده از کلیدی‌ترین متغیرهای اقتصادی همراه با عدم قطعیت ترسیم می‌شود. همچنین با شناسایی آینده‌های محتمل اقتصاد ایران، سعی می‌شود که اثرات امنیتی حاصل از این سناریوها نیز بیان شود.

## ۲- عدم قطعیت متغیرهای تاثیرگذار بر اقتصاد ایران

در این بخش مهم‌ترین عوامل تاثیرگذار بر مسیر حرکت اقتصاد ایران در گذشته شناسایی شده و نحوه تاثیرگذاری آن‌ها بر آینده اقتصاد ایران در افق زمانی پنج ساله مورد بررسی قرار می‌گیرد. به این منظور و در چند بخش اصلی اقتصاد ایران شامل منابع طبیعی، انباشت سرمایه و سرمایه‌گذاری، تجارت خارجی، متغیرهای نهادی و متغیرهای کلان اقتصادی به مهم‌ترین عوامل تاثیرگذار بر مسیر اقتصاد ایران در گذشته و آینده توجه خواهد شد و از این طریق برخی از عدم قطعیت‌های مرتبط با آینده اقتصاد ایران نیز شناسایی خواهد شد.

## ۲-۱- عدم قطعیت منابع طبیعی

اقتصاد ایران در سال‌های گذشته و احتمالاً در سال‌های آینده تحت تاثیر روند تغییرات دو منبع طبیعی پر اهمیت نفت و آب قرار دارد. بنابراین در ادامه به برخی جنبه‌های اقتصادی مرتبط با این دو منبع اشاره می‌شود.

## ۲-۱-۱- قیمت نفت و درآمدهای نفتی

نفت مهم‌ترین منبع درآمدی برای کشورهای صادرکننده نفت نظیر ایران است که علاوه بر تامین بخش عمده‌ای از منابع مالی ایران، تاثیر بسیاری نیز بر دیگر بخش‌های اقتصاد دارد. در ایران برنامه‌ریزی توسعه وابستگی شدید به درآمدهای نفتی داشته و تحقق یا عدم تحقق درآمدهای نفتی پیش‌بینی شده، مسیر توسعه را دستخوش تغییر می‌نماید. از منظر دیگر، گاهی از نفت به عنوان عامل تسریع حرکت به سمت مسیر توسعه یاد می‌شود و گاه آن را عامل دوری اقتصاد ایران از مسیر رشد و توسعه ناعدالتی‌های سیاسی و اجتماعی می‌-

## ۲-۲- عدم قطعیت انباشت سرمایه و سرمایه‌گذاری

سرمایه یکی از مهم‌ترین عوامل تاثیرگذار بر رشد اقتصادی به ویژه در کشورهای در حال توسعه است و تداوم فرآیند رشد و توسعه در اقتصاد قبل از هر چیز مستلزم سرمایه‌گذاری یا تشکیل سرمایه لازم برای رشد و توسعه اقتصادی است. به منظور آگاهی از روند تغییرات این متغیر می‌توان از نسبت تشکیل سرمایه ثابت به تولید ناخالص داخلی منتشر شده توسط صندوق بین‌المللی پول<sup>۱</sup> استفاده نمود. این متغیر در ایران و در مقایسه با کشورهای توسعه یافته مقدار بیشتری را نشان می‌دهد اما در مقایسه با کشورهای در حال توسعه پایین‌تر است. یعنی ایران به منظور قدم گذاشتن در مسیر توسعه بلند مدت به سطوح بالاتری از موجودی سرمایه نیازمند است. علاوه بر این، روند تغییرات این متغیر در ایران پس از سال ۲۰۰۴ نزولی و کم نوسان بوده است و انتظار می‌رود که در آینده نیز این روند ادامه داشته باشد. بنابراین انتظار می‌رود که حجم سرمایه با عدم قطعیت در اقتصاد ایران روبرو نباشد.

## ۲-۲-۱- سرمایه‌گذاری خصوصی

عوامل متعددی بر رفتار سرمایه‌گذاری بخش خصوصی تاثیرگذار هستند که مهم‌ترین آن‌ها عبارتند از نرخ بهره، سیاست‌های مالی، رشد اقتصادی، بی‌ثباتی اقتصادی و نااطمینانی ناشی از آن. حافظی (۱۳۹۳) رابطه معکوس بین نرخ بهره و سرمایه‌گذاری بخش خصوصی در ایران را مورد آزمون قرار داده و تایید می‌نماید. به منظور بررسی تاثیر سیاست‌های مالی بر سرمایه‌گذاری، حافظی نشان می‌دهد که خالص تاثیر مخارج دولت بر سرمایه‌گذاری در ایران منفی است. در پژوهشی که توسط مهرگان و سپه‌بان قره‌بابا (۱۳۹۲) صورت گرفته است، در کوتاه مدت و بلندمدت یک رابطه علی از سوی رشد اقتصادی به افزایش سرمایه‌گذاری بخش خصوصی وجود دارد. هادیان و تحویلی در سال ۱۳۹۳ به بررسی رابطه میان بی‌ثباتی و سرمایه‌گذاری بخش خصوصی پرداخته‌اند. با در نظر گرفتن موارد فوق، انتظار افزایش سرمایه‌گذاری در آینده وجود ندارد و رفتار این متغیر با قطعیت همراه است.

شناسند (بهبودی و همکاران، ۱۳۹۰). در ایران تاثیر درآمدهای نفتی بر محیط اقتصاد کلان از طریق نحوه هزینه کرد دولت قابل مشاهده کرد. با افزایش قیمت نفت و درآمدهای نفتی، مخارج دولت از طریق تزریق درآمدهای نفتی در ردیف بودجه جاری و عمرانی افزایش می‌یابد. با تزریق درآمدهای یاد شده در اقتصاد تقاضای کل افزایش می‌یابد تورم ایجاد می‌کند. این مسأله با کاهش قیمت نفت و در نتیجه کاهش درآمدهای دولت شکل انفجاری به خود می‌گیرد. کاهش قیمت نفت سبب می‌شود که دولت، به علت انعطاف‌ناپذیری هزینه‌های جاری، از هزینه‌های عمرانی بکاهد و آن را به هزینه‌های جاری منتقل کند. (صمدی و همکاران، ۱۳۸۸).

نکته قابل توجه در مورد نفت، ویژگی برونزا بودن قیمت نفت است که در زمان افزایش، درآمدهای هنگفتی را وارد اقتصاد ایران می‌کند و در زمان کاهش، موجب کاهش شدید درآمدهای ارزی می‌گردد (سلمانی و همکاران، ۱۳۹۱). این بی‌ثباتی‌ها، قیمت نفت را به عنوان یکی از متغیرهای همراه با عدم قطعیت در اقتصاد ایران تبدیل می‌کند.

## ۲-۱-۲- آب

در میان کشورهای جهان، ایران کشوری خشک و بیابانی با میانگین بارش پایین است. به همین دلیل مساله تامین آب مورد نیاز برای مصارف خانگی، کشاورزی و صنعتی یکی از دغدغه‌های جدی اقتصاد ایران در آینده خواهد بود. رشد جمعیت و شهرنشینی در ایران، تقاضای غذا و آب را تحت تاثیر قرار خواهد داد که در نتیجه آن آب مورد نیاز برای آبیاری مزارع و صنعت نیز متاثر خواهد شد. علاوه بر این، تغییرات آب و هوایی نیز از جنبه کاهش بارش و افزایش دما در ایران و به دنبال آن کاهش منابع عرضه آب زندگی ایرانیان را تحت تاثیر قرار خواهد داد و باعث بروز نارضایتی‌های اقتصادی و اجتماعی نیز خواهد شد. به طور خلاصه و با توجه به محدودیت‌های منابع آبی در ایران، به نظر نمی‌رسد که در افق زمانی پنج سال آینده این محدودیت قابل رفع باشد و از این جهت می‌توان گفت که آب و محدودیت‌های مترتب بر آن در آینده اقتصاد ایران با قطعیت همراه خواهد بود.

## ۲-۲-۲- توسعه مالی

تامین مالی به طور کلی به دو شیوه بانک محور و بازار محور صورت می‌گیرد. در کشورهای در حال توسعه مانند ایران، به دلیل نقایص و کمبودهای بازار سرمایه و گسترش نیافتن بازارهای سهام و نهادهای مالی، امکان تامین منابع از این طریق وجود ندارد. از سوی دیگر، هزینه بالای تامین سرمایه از بازارهای غیر رسمی نیز مزید بر علت می‌شود تا سهم بالایی از منابع مورد نیاز سرمایه‌گذاری از طریق بازار پول و اعتبارات بانکی تامین شوند. تامین مالی از طریق نظام بانکی تحت تاثیر دو عامل نرخ بهره و حجم تسهیلات اعطایی قرار دارد. اما نرخ بالای بهره در ایران تامین مالی از طریق نظام بانکی را نیز با مشکل مواجه کرده است (حافظی، ۱۳۹۳). با در نظر گرفتن دلایل فوق، نمی‌توان انتظار توسعه نهادهای مالی در افق زمانی ۵ سال آینده را داشت و انتظار می‌رود که رفتار این متغیر در آینده با قطعیت همراه باشد.

## ۲-۲-۳- سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی

سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی یکی از روش‌های مرسوم تامین مالی در کشورهای دنیا است و می‌توان آن را یکی از مهمترین پدیده‌های اقتصادی قرن حاضر دانست. دلیل اهمیت سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در ایجاد رشد اقتصادی و گسترش بازارهای جدید بین الملل کالا است که هم برای کشورهای توسعه یافته و هم برای کشورهای در حال توسعه از اهمیت زیادی برخوردار است. خالص جریان سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در ایران حداکثر پنج میلیارد دلار در سال ۲۰۱۲ بوده است و پس از این سال و به دلیل وضع تحریم‌های اقتصادی روند نزولی داشته است<sup>۱</sup>. افزایش یا کاهش حجم سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به شدت وابسته به تحریم‌های اقتصادی است و با توجه به وجود عدم قطعیت در لغو تحریم‌های اقتصادی، می‌توان گفت که سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی نیز با عدم قطعیت در آینده اقتصاد ایران همراه است.

## ۲-۳- عدم قطعیت متغیرهای تجارت خارجی

افزایش تجارت ناشی از افزایش همگرایی و یکپارچگی سریع در اقتصاد جهان است و به صورت مستقیم بر تولید کالاها به عنوان بخش قابل مشاهده اقتصاد اثر می‌گذارد. تجارت کارایی بنگاه‌ها را از طریق افزایش رقابت با بنگاه‌های خارجی بالا برده و یادگیری و انتقال فن‌آوری را تشویق نمایند و در نهایت زمینه رشد بیشتر اقتصادی را فراهم می‌آورد (ابریشمی و همکاران، ۱۳۸۸). مطالعه روند صادرات با استفاده از داده‌های بانک جهانی نشان می‌دهد که نسبت صادرات کالاها به تولید ناخالص داخلی در ایران تا سال ۲۰۰۵ صعودی بوده و پس از آن و با اعمال تحریم‌های شورای امنیت سازمان ملل مسیر نزولی را تا سال ۲۰۰۹ طی کرده است. پس از این زمان می‌توان گفت که حجم صادرات ایران روند همراه با نوسان با میانگین حدود ۲۵ درصد از تولید ناخالص داخلی را تجربه کرده است. در افق زمانی ۵ سال آینده انتظار می‌رود که حجم تجارت ایران تحت تاثیر تحریم‌های اقتصادی قرار داشته باشد و بر این اساس می‌توان گفت که تغییرات این متغیر در آینده با عدم قطعیت همراه است.

## ۲-۳-۱- نرخ ارز

نرخ ارز یکی از کلیدی‌ترین متغیرها در تجارت بین کشورها است. در کشوری مانند ایران که بخش عمده درآمد دولت از محل عایدات ارزی ناشی می‌شود این متغیر اهمیت ویژه‌ای دارد. نوسانات نرخ ارز بسیاری از متغیرهای کلان اقتصادی از جمله رشد اقتصادی را دستخوش تغییر و نوسان می‌کند. نوسانات نرخ ارز، سبب خروج بنگاه‌ها از چرخه تجارت و رفتن آن‌ها به سمت فعالیت‌های اقتصادی کم‌خطرتر و سودآورتر می‌شود. این وضعیت با کاهش ثبات اقتصادی و احساس امنیت اقتصادی در نهایت تولید ناخالص داخلی را با کاهش همراه خواهد نمود (عباسیان و همکاران، ۱۳۹۱). در افق زمانی ۵ سال آینده انتظار می‌رود که نرخ ارز رسمی در ایران همراه با نوسان باشد که دلیل عمده نوسان آن تغییرات درآمدهای نفتی و تحریم‌های اقتصادی است. بنابراین، نرخ ارز به دلیل نوسانات آن متغیری همراه با نااطمینانی و عدم قطعیت بوده و از این طریق رشد

تحول نهادها است و تنها در صورتی که نهادها از کیفیت مطلوب برخوردار باشند، اصلاحات اقتصادی منجر به بهبودی عملکرد اقتصادی می‌شود (شاه‌آبادی و دهقانی، ۱۳۸۹). با در نظر گرفتن توضیحات فوق، در ادامه به کیفیت نهادی در اقتصاد ایران و عدم قطعیت مترتب بر آن‌ها اشاره می‌شود.

#### ۲-۴-۱- فساد

فساد یک پدیده ناهنجار اقتصادی، سیاسی و فرهنگی است که کم و بیش در تمامی کشورها وجود دارد و مانعی اساسی در مقابل رشد و توسعه کشورها محسوب می‌گردد. مفهوم فساد اقتصادی از قرن هفدهم در ارتباط با سوءاستفاده کارکنان دولتی برای به دست آوردن منافع شخصی به کار برده شده‌است. ساده‌ترین و رایج‌ترین تعریف از فساد توسط بانک جهانی ارائه شده است. بر مبنای این تعریف، فساد عبارت است از سوءاستفاده از امکانات دولتی در جهت تامین منافع شخصی (سپهردوست و برجیسیان، ۱۳۹۵). به منظور درک بهتری از میزان کنترل فساد در ایران از شاخص کنترل فساد بانک جهانی استفاده می‌شود. بر اساس این شاخص که مقدار آن بین ۲/۵- تا ۲/۵ اندازه‌گیری می‌شود، کنترل فساد در ایران به عنوان یک متغیر نهادی موثر بر رشد اقتصادی در تمام سال‌های پس از سال ۲۰۰۰ مقداری نازل و منفی بوده است. به عبارتی سطح پایین کنترل فساد در ایران تاثیر منفی بر روند حرکت اقتصاد ایران داشته و انتظار می‌رود در آینده نیز این روند ادامه داشته باشد و عدم قطعیتی در این باره متصور نیست.

#### ۲-۴-۲- ثبات سیاسی

کمیجانی (۱۳۹۲) بی‌ثباتی سیاسی را یک وضعیت متزلزل می‌داند که حکومت در خصوص نحوه اداره جامعه، حفظ حاکمیت یا تمامیت ارضی خود با آن مواجه است. ثبات سیاسی یکی از پیش‌شرط‌های اساسی رشد و توسعه اقتصادی است. مشکل سیاسی و اجرایی در کشورهای در حال توسعه، در نبود یا کمبود منابع مورد نیاز برای توسعه قرار نمی‌گیرد. بلکه این وضعیت ناشی از گسیخته‌گی اجتماعی و سیاسی خواسته‌های مردم این

اقتصادی در ایران را از مسیر تاثیرگذاری بر سرمایه‌گذاری داخلی و خارجی متاثر می‌کند.

#### ۲-۳-۲- آزادسازی تجاری و مالی

آزادسازی بیانگر حذف مداخله دولت در بازارهای مالی، بازار سرمایه و رفع موانع تجاری است (استیگلیتز، ۲۰۰۲). اولین و ابتدایی‌ترین فرصت به دست آمده از فرآیند آزادسازی، تجارت آزاد است که اثر آن روی اقتصاد جهانی قابل مشاهده است. علاوه بر این، افزایش جریان‌های مالی و تجاری به صورت حاشیه‌ای منتهی می‌شود به توزیع مجدد سرمایه که می‌تواند به کشورهای در حال توسعه کمک کند تا از توقف در مسیر توسعه رها شوند (فارو، ۱۹۹۸). به منظور درک بهتری از موقعیت آزادی تجاری و مالی اقتصاد ایران و جایگاه جهانی آن، می‌توان از شاخص آزادی تجاری و آزادی مالی بنیاد هریتیج<sup>۵</sup> استفاده نمود. شاخص آزادی تجاری در سال‌های گذشته در ایران به صورت میانگین حدود ۵۵ بوده است. این شاخص در در مقایسه با کشورهای توسعه یافته و در حال توسعه در سطح نازل تری قرار دارد و در افق ۵ سال آینده نیز به دلایل نهادی، انتظار تغییر عمده درباره آن وجود ندارد. بنابراین این متغیر در افق زمانی ۵ سال آینده از قطعیت برخوردار خواهد بود و نمی‌توان عدم قطعیت برای آن متصور بود.

#### ۲-۴-۳- عدم قطعیت متغیرهای نهادی و ساختاری

تجربه موفق کشورهای آسیایی به ویژه چین در مقایسه با تجربه نه چندان موفق کشورهای اروپای شرقی و بسیاری از کشورهای در حال توسعه، برای گذار سریع از اقتصاد با برنامه‌ریزی متمرکز به اقتصاد بازار، بیانگر این واقعیت است که انجام اقدامات اقتصادی چون کاستن بار تصدی‌گری دولت، مقررات زدایی، خصوصی‌سازی، آزادسازی قیمت، آزادسازی تجارت خارجی و نظایر آن‌ها هرچند ضروریست، اما لزوماً نمی‌تواند باعث افزایش رشد اقتصادی یک کشور شود. تفاوت عملکرد این دو گروه علی‌رغم انجام اصلاحات اقتصادی در هر دو، کیفیت متفاوت نهادهای غیر اقتصادی در این کشورها است. به بیان دیگر عملکردهای اقتصاد در طول زمان متاثر از

#### ۲-۴-۴- اثر بخشی دولت

اثر بخشی دولت به مفهوم عملکرد بهتر نهادها و فرآیندها در تامین نیازهای جامعه در کنار بهره‌برداری بهینه از منابع موجود است. وجود دستگاه اداری کارآمد و کاهش دیوان‌سالاری، منجر به عملکرد بهتر حکومت و افزایش کارایی دولت می‌شود (حیدری و همکاران، ۱۳۹۴). شاخص اثر بخشی دولت برای ایران در تمام سال‌های پس از سال ۲۰۰۰ و با توجه به محاسبات بانک جهانی، مقدار منفی است. به طوری که این متغیر تا سال ۲۰۱۳ حدود ۰/۵- بوده است، اما پس از سال ۲۰۱۳ روند رو به رشدی به خود گرفته است. یعنی در این سال‌ها اثر بخشی دولت در ایران افزایش داشته است و از این جهت انتظار می‌رود که رشد اقتصادی ایران نیز از آن در جهت بهبود تاثیر پذیرد. علاوه بر این انتظار می‌رود که رفتار این متغیر در آینده با قطعیت همراه باشد.

#### ۲-۴-۵- حقوق مالکیت

حقوق مالکیت حق اقتصادی افراد با توجه به توانایی کسب درآمد، فروش یا انتقال یک دارایی چه به لحاظ حقوقی و چه به طور رسمی و غیر رسمی است. اگر حقوق مالکیت به خوبی تعریف گردد هزینه‌های مبادله کاهش می‌یابد. رعایت حقوق مالکیت، میزان نااطمینانی سرمایه‌گذاران جهت ورود به فعالیت‌های اقتصادی را کاهش داده و به عبارتی انگیزه سرمایه‌گذاران داخلی و خارجی در مشارکت اقتصادی را افزایش می‌دهد (فورباتن<sup>۶</sup> و ریچتر<sup>۷</sup>، ۲۰۰۰). با توجه به شاخص حقوق مالکیت بین‌المللی<sup>۸</sup> و از بین ۱۲۸ کشوری که این شاخص برای محاسبه می‌شود، ایران در سال ۲۰۱۶ حائز جایگاه پایین ۱۰۱ بوده است. با توجه به روند تغییرات این متغیر و مقدار پایین آن انتظار نمی‌رود که در افق زمانی پنج سال آینده حفاظت از حقوق مالکیت تغییرات عمده‌ای در ایران داشته باشد و از این جهت عدم قطعیتی قابل مشاهده نیست.

#### ۲-۴-۶- تحریم‌های اقتصادی

اگر جنگ نظامی به عنوان سلسله اقدامات سازمان-یافته و خشونت‌آمیز به منظور تسخیر و نابودی نظام

جوامع است. در شرایط بی‌ثباتی سیاسی، انجام برنامه‌های توسعه با شکست و ناکامی روبرو می‌شود. بی‌ثباتی سیاسی و افزایش ریسک، موجب کاهش ارزش مورد انتظار سرمایه و تضعیف انگیزه پس انداز و سرمایه‌گذاری می‌شود (شاه آبادی و بهاری، ۱۳۹۳). شاخص ثبات سیاسی بانک جهانی میزان ثبات کشورهای جهان را بین دو عدد ۲/۵- تا ۲/۵ محاسبه می‌کند. مقدار این شاخص برای ایران در تمام سال‌های پس از سال ۲۰۰۰ کمتر از صفر اندازه گیری شده است که نشان دهنده سطح پایین ثبات سیاسی در ایران است. نتیجه این ثبات سیاسی پایین، افزایش ریسک سرمایه‌گذاری و کاهش سرمایه‌گذاری است که منجر به کاهش رشد اقتصادی در ایران می‌شود. در آینده نزدیک نیز انتظار می‌رود که این متغیر به دلیل وجود برخی مشکلات سیاسی و جنگ در منطقه خاورمیانه و همچنین چگونگی تقسیم‌بندی‌های قدرت در داخل کشور با عدم قطعیت همراه باشد.

#### ۲-۴-۳- حاکمیت قانون

یکی از مهم‌ترین متغیرهای نهادی تاثیرگذار بر رشد اقتصادی حاکمیت قانون است. قانون روابط بین دولت با شهروندان و شهروندان با یکدیگر را تنظیم می‌کند. با گذشت زمان و پیچیده‌تر شدن تعاملات میان دولت و شهروندان، نقش قانون و بالطبع مفهوم حاکمیت قانون، در جوامع امروزی پیچیده‌تر و قابل ملاحظه‌تر شده است. حاکمیت قانون و پیامدهای آن یکی از عناصر کلیدی حکمرانی خوب است که با چگونگی عملکرد خود رشد اقتصادی را نیز متاثر می‌سازد (حیدری و علی‌نژاد، ۱۳۹۳). بر مبنای نتایج شاخص حاکمیت قانون بانک جهانی، نه تنها حاکمیت قانون در ایران در سطح پایینی قرار دارد، بلکه شرایط بدتری نیز در طی سال‌های اخیر تجربه کرده است. بنابراین از این منظر، انتظار می‌رود که سطح پایین حاکمیت قانون در ایران تاثیر منفی بر رشد اقتصادی در آینده داشته باشد. علاوه بر این، احتمال وجود عدم قطعیت در رفتار این شاخص نیز قابل مشاهده نیست.

## ۲-۵-۲- درآمدهای مالیاتی دولت

مالیات‌ها طبیعی‌ترین منابع تامین مالی مخارج دولت‌ها به شمار می‌روند. مالیات از موثرترین عناصر همه نظام‌های اقتصادی و اجتماعی است که تاثیر آن علاوه بر حوزه‌های اقتصادی، می‌تواند حوزه‌های سیاسی را نیز در بر گیرد (دادگر و همکاران، ۱۳۹۲). در اقتصاد ایران و با کاهش درآمدهای نفتی شوک منفی به تولید وارد می‌شود. در این موقعیت که دولت در تامین منابع مالی هزینه‌های خود با مشکل مواجه است، در کنار استقراض از بانک مرکزی، افزایش اخذ مالیات به طرق مختلف را نیز به عنوان راهکار دوم در تامین مالی مورد استفاده قرار می‌دهد. اما با نوسان درآمدهای نفتی دولت، تولید ناخالص داخلی نیز در ایران از آن متاثر شده و دچار نوسان می‌شود. بنابراین و با توجه به تاثیرپذیری درآمدهای مالیاتی از تولید ناخالص داخلی و همچنین درآمدهای نفتی، می‌توان عنوان نمود که درآمدها و سیاست‌های مالیاتی در ایران با عدم قطعیت همراه است.

## ۲-۵-۳- سیاست‌های مالی

سیاست مالی عبارت است از سیاست دولت درباره سطح خریدهای دولت، سطح پرداخت‌های انتقالی و ساختار مالیاتی. در اقتصاد، سیاست مالی با استفاده از دو ابزار اصلی درآمد دولت (مالیات) و مخارج دولت (هزینه) برای تاثیر گذاری در سطح تقاضای عمومی اعمال می‌شود. دولت‌ها در تلاشند که اهداف اقتصادی نظیر ثبات قیمت‌ها، اشتغال کامل و رشد اقتصادی را به کمک این سیاست‌ها دست آورند. سیاست‌های مالی دولت در ایران با توجه به منبع مورد استفاده در تامین مالی دولت اعم از درآمدهای نفتی و استقراض از بانک مرکزی، بی‌ثباتی و ناطمینانی در بخش‌های حقیقی اقتصاد را به همراه دارند. بنابراین، می‌توان این سیاست‌ها را به دلیل نحوه تامین مالی همراه با ناطمینانی، به عنوان یک عدم قطعیت در اقتصاد ایران برشمرد.

## ۲-۵-۴- سیاست‌های پولی

سیاست‌های پولی و تغییر حجم پول یکی از قوی‌ترین ابزارهای اقتصادی در اختیار سیاستگذاران اقتصادی است

سیاسی ایران تعبیر شود، آنگاه می‌توان تحریم اقتصادی را به سلسله اقدام‌های سازمان‌یافته و خصومت‌آمیز بر علیه این کشور در نظر گرفت. در تحریم اقتصادی بر خلاف جنگ نظامی، نیروی نظامی رویت نمی‌شود و عملیات‌های تهاجمی آن پنهان و نرم بوده و بر عملکرد اقتصادی ایران تاثیر سوء می‌گذارد (کریمی پور، ۱۳۹۳). با توجه به عدم تغییر نگرش سیاسی کشورهای تحریم‌کننده نسبت به ایران و از سویی امضای توافق برجام، به نظر می‌رسد که لغو یا عدم لغو تحریم‌های اقتصادی یک عامل تاثیرگذار در اقتصاد ایران با عدم قطعیت بالا در آینده خواهد بود.

## ۲-۵-۵- عدم قطعیت متغیرهای کلان اقتصادی

در مباحث مربوط به رشد و توسعه اقتصادی بسیاری از عوامل دخیل هستند که به برخی از مهم‌ترین این موارد در بخش‌های پیشین اشاره شد. اما در کنار این عوامل تاثیر متغیرهای کلان اقتصادی نظیر مخارج دولت، سیاست‌های پولی و مالی، نظام مالیاتی و ... بر رشد اقتصادی نیز قابل توجه و قابل اشاره است که در ادامه به چگونگی تاثیر این عوامل بر رشد اقتصادی و همچنین روند این متغیرها در اقتصاد ایران توجه خواهد شد.

## ۲-۵-۱- هزینه‌های دولت

یکی از مهم‌ترین مسیرهای تامین درآمد دولت در ایران فروش نفت و گاز است که بیش از نیمی از مخارج دولت وابسته به این عامل است. مساله قابل توجه درباره درآمدهای نفتی دولت، نوسان این درآمدها با نوسان قیمت نفت در بازارهای جهانی است. با نوسان درآمدهای نفتی دولت و به دنبال آن نوسان مخارج دولت، اکثر بخش‌های اقتصاد ایران نیز دستخوش تغییر و نوسان شده و بی‌ثباتی اقتصادی در کشور رخ می‌دهد. در مجموع و در تحلیل مرتبط با عدم قطعیت مخارج دولت در ایران می‌توان عنوان کرد که هزینه‌های دولت در ایران به دلیل تبعیت از درآمدهای پرنوسان نفتی با عدم قطعیت همراه است، مگر آن که دولت با استفاده از ابزارهایی مانند صندوق ذخیره ارزی یا صندوق توسعه، تاثیر نوسان درآمدهای نفتی بر مخارج دولت را کاهش دهد.

در بین عوامل موثر بر رشد اقتصادی، سرمایه‌گذاری به عنوان یک عامل عمده و تاثیرگذار بر فرآیند رشد اقتصادی شناخته می‌شود و زمانی سرمایه‌گذاری صورت می‌گیرد و یا به نتیجه مطلوب منتج می‌شود که سیاست‌های کلان اقتصادی دولت در فضایی مطمئن و باثبات پی‌ریزی شود (هادیان و تحویلی، ۱۳۹۳). ثبات اقتصادی در یک اقتصاد وابستگی شدیدی به چگونگی اعمال سیاست‌های پولی و مالی دارد و از آنجا که سیاست‌های پولی و مالی در ایران همراه با نوسان و نااطمینانی بوده‌اند و در آینده نیز انتظار می‌رود که این سیاست‌ها همراه با نااطمینانی باشند، لذا می‌توان گفت که بی‌ثباتی اقتصادی جزء ساختاری اقتصاد ایران محسوب شده و ثبات اقتصادی در ایران با عدم قطعیت همراه است.

### ۳- روش پژوهش

هدف از نگارش این پژوهش استخراج برخی از سناریوهای محتمل از آینده اقتصاد ایران است. سناریونگاری روش بسیار موثر و مفیدی برای برنامه‌ریزی میان‌مدت و بلندمدت در شرایط عدم قطعیت است. این روش به واحدهای تحلیل کمک می‌کند که علاوه بر تهیه برنامه‌های متعدد برای رویدادهای غیرمترقبه، جهت‌گیری درستی نسبت به سیر رویدادهای آینده داشته و بنابراین موضوعات مهم و درستی را در کانون توجه خود قرار دهند. (نادرمنش و همکاران، ۲۰۰۹)

به منظور نگارش سناریوهای آینده اقتصاد ایران در این پژوهش، رویکرد عدم قطعیت بحرانی<sup>۹</sup> مورد استفاده قرار می‌گیرد. پایه‌گذار اصلی رویکرد عدم قطعیت‌های بحرانی پیتر شوارتز<sup>۱۰</sup> دبیر کل «شبکه جهانی کسب‌وکار»<sup>۱۱</sup> است. فرآیند سناریونگاری در این رویکرد، شامل تدوین فهرست عوامل شکل‌دهنده و روندهای مربوط به آینده و سپس دسته‌بندی آن‌ها در یکی از سه گروه زیر است:

۱) روندها و عوامل شکل‌دهنده‌ای که مداوم تاثیر آن‌ها بر موضوع موردنظر تا حدود زیادی قطعی است؛

۲) روندها و عوامل شکل‌دهنده‌ای که بر موضوع موردنظر تاثیر قطعی ندارند؛

که تاثیر آن بر متغیرهای اقتصادی گاهی غیر قابل انتظار و ناخواسته است. سیاست پولی یک ابزار طرف تقاضا در اقتصاد کلان است که بانک مرکزی جهت ثبات بخشی به اقتصاد از آن استفاده می‌کند. اما در ایران دولت متناسب با تعهدات عمومی ایجاد شده و در صورت عدم تامین منابع مالی از طرق دیگر به استقراض از بانک مرکزی متوسل می‌شود (طاهری فرد و موسوی آزاد، ۱۳۸۷). در صورت رشد حجم پول بیش از کشش درآمدی تقاضای پول که در ایران نیز عموماً این شرایط رخ می‌دهد، انتظار می‌رود که این افزایش حجم پول منجر به بروز تورم و کاهش دستمزدهای حقیقی شود. با توجه به تغییر نحوه هزینه کرد دولت با تغییر دولت در ایران و همچنین نوسان درآمدهای نفتی، حجم پول در ایران نیز در راستای تامین اهداف مالی دولت‌ها به صورت مداوم با نوسان همراه بوده است. بنابراین می‌توان گفت که سیاست‌های پولی و حجم پول یک متغیر همراه با عدم قطعیت در اقتصاد ایران است.

### ۲-۵-۵- تورم

تورم عبارت است از رشد مستمر و همه‌گیر قیمت‌ها که چهار نظریه فشار تقاضا، فشار هزینه، نظریه‌های پولی و عوامل ساختاری به عنوان عوامل آن در نظر گرفته می‌شوند (عمادزاده، ۱۳۸۴). آمار و ارقام مربوط به تورم در اقتصاد کشور حکایت از این دارد که تورم و نااطمینانی تورم به دلایل فوق‌الذکر در طی چهار دهه اخیر در اقتصاد ایران شکل گرفته و به وضوح قابل رویت است. علاوه بر این، تورم در اقتصاد ایران حالت ماندگار و مزمن پیدا کرده و به عنوان پدیده‌ی اقتصادی نامطلوب، آثار مخربی بر اقتصاد ایران داشته است. نرخ‌های بالا و پرنوسان تورم در ایران به مفهوم وجود عدم قطعیت در رفتار تورم در ایران است که این عدم قطعیت از مسیر کاهش سرمایه‌گذاری، تولید ملی را نیز به صورت منفی متاثر می‌کند.

### ۲-۵-۵- ثبات اقتصادی

رشد اقتصادی یکی از اهدافی است که دولت‌ها برای نیل به آن به اتخاذ سیاست‌های مختلف، اهتمام می‌ورزند.



به همین منظور و در قدم اول، روند حرکتی مهم‌ترین متغیرهای اقتصادی تاثیرگذار بر اقتصاد ایران در بخش قبل و با استفاده از مرور ادبیات مورد مطالعه و ارزیابی قرار گرفت و با توجه به نحوه تغییرات این متغیرها در گذشته اقتصاد ایران، یازده متغیر به عنوان متغیرهای همراه با عدم قطعیت شناسایی شد که فهرست این متغیرها در جدول ۱ قابل مشاهده است. در ادامه و به منظور استخراج متغیرهای همراه با عدم قطعیت بالا و بحرانی از بین یازده متغیر همراه با عدم قطعیت در اقتصاد ایران، از پرسشنامه‌های تکمیل شده توسط ۴۰ خبره اقتصادی استفاده شد.

### ۳-۱- پرسشنامه

در پرسشنامه و با بهره‌گیری از مقیاس‌های گوناگون، دیدگاه و بینش فرد پاسخگو مورد سنجش قرار می‌گیرد. در این پژوهش نیز از پرسشنامه برای شناسایی عدم قطعیت‌های بحرانی و میزان اهمیت آن‌ها در اقتصاد ایران استفاده شد. در پرسشنامه طراحی شده برای این منظور، عدم قطعیت‌ها به صورت دوگانه و با توصیف دو حالت احتمالی از آینده پیشران موردنظر تهیه شد. نمونه سوال این پرسشنامه در جدول ۲ قابل مشاهده است. بر اساس این پرسشنامه از خبرگان پاسخ‌دهنده خواسته شد تا میزان موافقت خود با وقوع هر یک از دو وضعیت حدی گزاره مورد نظر در در اقتصاد ایران و میزان اهمیت متغیر ذکر شده را اعلام نمایند.

۳) روندها و عوامل شکل‌دهنده‌ای که تاثیر آن‌ها نامعلوم است و با عدم قطعیت همراه با تاثیر زیاد و کم بیان می‌شوند. (علیزاده و همکاران، ۱۳۸۷)

با توجه به امکان دسته‌بندی عوامل و روندهای شکل‌دهنده مسیر اقتصاد یک کشور مانند ایران بر اساس سه گروه ذکر شده در بالا و انتخاب مهم‌ترین عوامل تاثیرگذار غیر قطعی بر آینده اقتصاد ایران از میان آن‌ها، به نظر می‌رسد که رویکرد عدم قطعیت‌های بحرانی، رهیافتی مطلوب برای ترسیم سناریوهای آینده اقتصاد ایران باشد.

### جدول ۱- عوامل کلیدی همراه با عدم قطعیت موثر بر

#### اقتصاد ایران

عوامل کلیدی تاثیرگذار بر اقتصاد ایران (دارای عدم اطمینان یا عدم قطعیت)
قیمت نفت
سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی
حجم تجارت خارجی
نرخ ارز
ثبات سیاسی
تحریم‌های اقتصادی بین‌المللی
هزینه‌های دولت
درآمدهای مالیاتی دولت
سیاست‌های پولی
نرخ تورم
ثبات اقتصادی

منبع: یافته‌های پژوهش

### جدول ۲- پرسشنامه مرتبط با تعیین عدم قطعیت‌های بحرانی در اقتصاد ایران

میزان اهمیت هر متغیر و تغییرات آن در مسیر آینده اقتصاد ایران	با کدام حالت حدی پرسش موافق هستید؟				میزان تخصص شما در مورد موضوع پرسش شده				پرسش
	زیاد	متوسط	کم	هیچ	زیاد	متوسط	کم	هیچ	
									پرسش: "حالت اول متغیر" یا "حالت دوم متغیر"

#### ۴- تعیین عدم قطعیت‌های بحرانی در اقتصاد ایران

با استفاده از پرسشنامه طراحی شده برای این پژوهش نیروهای پیشران غیر قطعی و کلیدی اقتصاد ایران از بین این یازده متغیر انتخاب خواهند شد. به این منظور نتایج حاصل از تحلیل پرسشنامه‌ها با استفاده از شاخص‌های اجماع، اهمیت و پراکندگی در ادامه ارائه می‌شود.

#### ۴-۱- تعیین عدم قطعیت‌های بحرانی با استفاد از شاخص اجماع

شاخص اجماع نشان‌دهنده این است که خبرگان تا چه حد بر موضوع مورد بحث اجماع و توافق دارند. هر چه شاخص اجماع به صفر نزدیک‌تر باشد، نشان‌دهنده این است که درباره آن موضوع تشتت آراء وجود دارد و اجماعی بر یکی از آن دو حالت حدی وجود ندارد و بنابراین می‌توان گفت که متغیر مذکور همراه با عدم قطعیت است (اشرفی بفرولی، ۱۳۹۵). نتایج حاصل از

تحلیل و اندازه‌گیری این شاخص برای یازده گزاره همراه با عدم قطعیت در اقتصاد ایران در جدول ۳ گزارش شده است.

با توجه به نتایج درج شده در جدول ۳ دیده می‌شود که این شاخص برای عدم قطعیت ۱ یعنی قیمت نفت برابر با ۰/۰۵-، عدم قطعیت ۶ یعنی تحریم‌های اقتصادی برابر با ۰/۰۵ و عدم قطعیت ۱۰ یعنی نرخ تورم برابر با ۰/۱۲ و بسیار نزدیک به صفر می‌باشند. به عبارتی درباره این سه عدم قطعیت در بین خبرگان اقتصادی اجماع وجود ندارد و می‌توان این سه عدم قطعیت را به عنوان عدم قطعیت‌های بحرانی انتخاب شده توسط شاخص اجماع در نظر گرفت. قابل ذکر است که مقدار شاخص اجماع برای دیگر عدم قطعیت‌های مورد بررسی در این پژوهش اختلاف بسیاری با سه عدم قطعیت بحرانی انتخاب شده دارد و نمی‌توان بر اساس این شاخص آن‌ها را عدم قطعیت بحرانی در نظر گرفت.

تعداد پاسخ‌ها به گزینه الف × ۲ + تعداد پاسخ‌ها به گزینه ب × ۱ + تعداد پاسخ‌ها به گزینه ج × (-۲) + تعداد پاسخ‌ها به گزینه د × (-۱)

شاخص اجماع =

تعداد کل پاسخ‌ها به گزینه‌های الف تا ه

#### جدول ۳- تعیین عدم قطعیت‌های بحرانی با استفاده از شاخص اجماع

شاخص اجماع	عدم قطعیت‌های اقتصادی
-۰/۰۵	عدم قطعیت ۱: "افزایش قیمت نفت" یا "کاهش قیمت نفت" در ۵ سال آینده
۰/۶۲۵	عدم قطعیت ۲: "افزایش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی" یا "کاهش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی" در ۵ سال آینده
۰/۸۵	عدم قطعیت ۳: "افزایش تجارت خارجی" یا "کاهش تجارت خارجی" در ۵ سال آینده
۱/۲۵	عدم قطعیت ۴: "افزایش نرخ ارز" یا "کاهش نرخ ارز" در ۵ سال آینده
۰/۵	عدم قطعیت ۵: "وجود ثبات سیاسی" یا "عدم وجود ثبات سیاسی" در ۵ سال آینده
۰/۰۵	عدم قطعیت ۶: "رفع کامل تحریم‌های اقتصادی" یا "عدم رفع تحریم‌های اقتصادی و اعمال تحریم‌های جدید" در ۵ سال آینده
۰/۷۵	عدم قطعیت ۷: "افزایش هزینه‌های دولت" یا "کاهش هزینه‌های دولت" در ۵ سال آینده
۱/۰۷۵	عدم قطعیت ۸: "افزایش درآمدهای مالیاتی دولت" یا "کاهش درآمدهای مالیاتی دولت" در ۵ سال آینده
۰/۵۲۵	عدم قطعیت ۹: "اعمال سیاست‌های پولی انبساطی" یا "اعمال سیاست‌های پولی انقباضی" در ۵ سال آینده
۰/۱۲۵	عدم قطعیت ۱۰: "افزایش نرخ تورم" یا "کاهش نرخ تورم" در ۵ سال آینده
۰/۱۶	عدم قطعیت ۱۱: "ثبات اقتصادی" یا "عدم وجود ثبات اقتصادی" در ۵ سال آینده

منبع: یافته‌های پژوهش

با توجه به جدول زیر پراکندگی پاسخ‌ها در عدم قطعیت ۶ یعنی تحریم‌های اقتصادی بالاترین میزان را نشان می‌دهد و به همین جهت می‌توان گفت که این عدم قطعیت، کلیدی‌ترین گزاره همراه با عدم قطعیت در بین ۱۱ گزاره مورد استفاده است. دو عدم قطعیت دیگر یعنی عدم قطعیت ۱ و عدم قطعیت ۱۰ نیز در مقایسه با دیگر عدم قطعیت‌ها سطح پراکندگی بالایی را نشان می‌دهند و می‌توان نتیجه گرفت که نتایج حاصل از شاخص اجماع در مورد این دو عدم قطعیت ناشی از تجمع پاسخ‌ها بر روی گزاره "نمی‌توانم پاسخ صریحی بدهم" و "نمی‌دانم" نیست. قابل ذکر است که ضریب تغییرات دو عدم قطعیت ۹ و عدم قطعیت ۵ نیز مقدار بالایی را نشان می‌دهند، اما به دلیل سطح بالاتر اجماع در این عدم قطعیت‌ها با توجه به شاخص اجماع نمی‌توان این دو متغیر یعنی اعمال سیاست‌های پولی و ثبات سیاسی را به عنوان عدم قطعیت بحرانی در نظر گرفت. در مجموع و با توجه به دو شاخص استفاده شده برای تشخیص عدم قطعیت می‌توان عنوان کرد که سه عدم قطعیت قیمت نفت، تحریم‌های اقتصادی و نرخ تورم، سه عدم قطعیت بحرانی انتخاب شده در این قسمت خواهند بود.

#### ۴-۲- تعیین عدم قطعیت‌های بحرانی با استفاده از شاخص پراکندگی ضریب تغییرات

ضریب واریانس یا ضریب تغییرات یکی دیگر از شاخص‌های بررسی عدم قطعیت گزاره‌های استفاده شده در پرسشنامه است که از نسبت انحراف معیار نمونه به میانگین داده‌ها به دست می‌آید. هر چه این عدد کوچک‌تر باشد نشان می‌دهد که پاسخ‌ها پراکندگی کمتری دارند. هر چه ضریب واریانس در مورد یک عدم قطعیت بیشتر باشد نشان‌دهنده آن است که تعداد پاسخ‌ها در دو حد بازه بیشتر بوده است. برای مثال اگر شاخص اجماع برای دو عدم قطعیت صفر باشد ممکن است یکی از آن‌ها در نتیجه تعداد زیاد پاسخ‌ها به گزینه "ممتنع" بوده و پراکندگی پاسخ‌ها کم باشد و دیگری در نتیجه اینکه نیمی از پاسخ‌ها "شدیدا حالت اول" و نیمی دیگر از آن‌ها "شدیدا حالت دوم" بوده و پراکندگی داده‌ها زیاد باشد، که مسلماً حالت دوم نمایانگر شدت عدم قطعیت بیشتر است. بنابراین در نظر گرفتن هر دو شاخص پراکندگی و اجماع در کنار هم دقت را در شناسایی عدم قطعیت بحرانی بالاتر می‌برد. بر این اساس نتایج حاصل از تحلیل شاخص اجماع گزاره‌های اقتصادی پرسشنامه در جدول ۴ ارائه شده است.

جدول ۴ - تعیین عدم قطعیت با استفاده از شاخص پراکندگی ضریب تغییرات

شاخص اهمیت	شاخص پراکندگی ضریب تغییرات	عدم قطعیت‌های اقتصادی
۸۵	۰/۳۸	عدم قطعیت ۱: "افزایش قیمت نفت" یا "کاهش قیمت نفت" در ۵ سال آینده
۷۲/۵	۰/۳۳	عدم قطعیت ۲: "افزایش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی" یا "کاهش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی" در ۵ سال آینده
۷۶/۸۷	۰/۲۹	عدم قطعیت ۳: "افزایش تجارت خارجی" یا "کاهش تجارت خارجی" در ۵ سال آینده
۷۶/۸۷	۰/۱۷	عدم قطعیت ۴: "افزایش نرخ ارز" یا "کاهش نرخ ارز" در ۵ سال آینده
۸۶/۲۵	۰/۳۸	عدم قطعیت ۵: "وجود ثبات سیاسی" یا "عدم وجود ثبات سیاسی" در ۵ سال آینده
۸۱/۲۵	۰/۴۹	عدم قطعیت ۶: "رفع کامل تحریم‌های اقتصادی" یا "عدم رفع تحریم‌ها و اعمال تحریم‌های جدید" در ۵ سال آینده
۶۵/۶۲	۰/۲۷	عدم قطعیت ۷: "افزایش هزینه‌های دولت" یا "کاهش هزینه‌های دولت" در ۵ سال آینده
۷۰	۰/۲۶	عدم قطعیت ۸: "افزایش درآمدهای مالیاتی دولت" یا "کاهش درآمدهای مالیاتی دولت" در ۵ سال آینده
۷۲/۵	۰/۴۱	عدم قطعیت ۹: "اعمال سیاست‌های پولی انبساطی" یا "اعمال سیاست‌های پولی انقباضی" در ۵ سال آینده
۶۸/۷۵	۰/۴	عدم قطعیت ۱۰: "افزایش نرخ تورم" یا "کاهش نرخ تورم" در ۵ سال آینده
۸۲/۷۵	۰/۳۵	عدم قطعیت ۱۱: "ثبات اقتصادی" یا "عدم وجود ثبات اقتصادی" در ۵ سال آینده

منبع: یافته‌های پژوهش

### ۳-۴- تعیین عدم قطعیت‌های بحرانی با استفاده از شاخص اهمیت

این شاخص نشان‌دهنده میزان اهمیتی است که خبرگان برای هر یک از عدم قطعیت‌ها در تأثیرگذاری آن

بر آینده اقتصاد ایران قائل بوده‌اند. هر چه شاخص اهمیت مقدار بیشتر باشد، نشان‌دهنده این است که میزان اهمیت آن گزاره از نظر خبرگان بیشتر است. نتایج محاسبه این شاخص نیز در جدول ۴ ارائه شده است.

تعداد پاسخ‌ها به گزینه زیاد  $\times 10 +$  تعداد پاسخ‌ها به گزینه متوسط  $\times 5 +$  تعداد پاسخ‌ها به گزینه کم  $\times 25 +$  تعداد پاسخ‌ها به گزینه هیچ  $\times 0$

= شاخص اهمیت

تعداد کل پاسخ‌ها

اهمیت به عنوان عدم قطعیت‌های بحرانی در اقتصاد ایران شناسایی و تعیین شدند. در این بخش تلاش خواهد شد که ضمن ارائه چارچوب منطقی توسعه سناریوها، این سناریوها روایت شده و پیامدهای امنیتی آن‌ها نیز ارائه گردد.

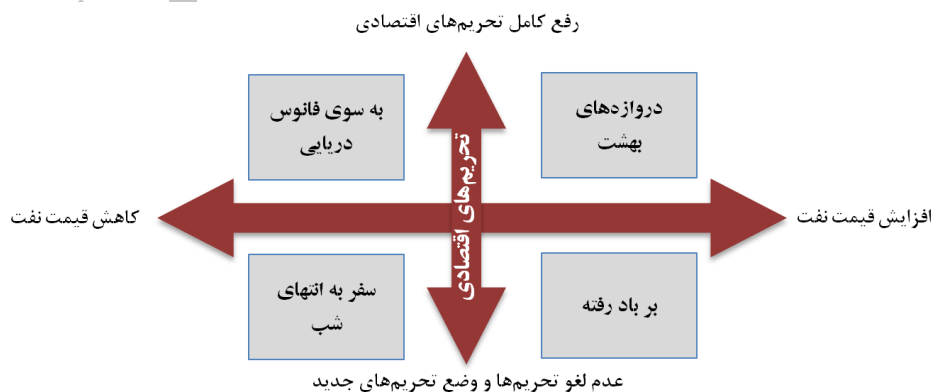
نتایج ثبت شده در این جدول نشان می‌دهد که چهار عدم قطعیت قیمت نفت، ثبات سیاسی، تحریم‌های اقتصادی و ثبات سیاسی از بالاترین میزان اهمیت در اقتصاد ایران برخوردار هستند. اما از آنجا که ثبات سیاسی و ثبات اقتصادی با توجه به دو شاخص اجماع و پراکندگی از عدم قطعیت کمتری برخوردار هستند، می‌توان گفت که قیمت نفت و تحریم‌های اقتصادی عدم قطعیت‌های بحرانی و نهایی انتخاب شده در این پژوهش برای نگارش سناریوهای آینده اقتصاد ایران خواهند بود.

#### ۴-۴-۱- چارچوب تدوین سناریوهای اقتصاد ایران

از تلاقی دو عدم قطعیت بحرانی قیمت نفت و تحریم‌های اقتصادی، چهار فضای سناریویی از آینده اقتصاد ایران ایجاد می‌گردد که حاصل تلفیق دو حالت حدی عدم قطعیت‌های بحرانی است. چارچوب منطقی نگارش سناریوهای آینده اقتصاد ایران در شکل ۱ ارائه شده است. در بخش بعد هر یک از سناریوهای آینده اقتصاد ایران با توجه به چارچوب منطقی سناریوها تشریح خواهد شد.

#### ۴-۴- سناریوهای روبروی اقتصاد ایران در افق زمانی پنج ساله

در گام پیشین دو عدم قطعیت قیمت نفت و تحریم‌های اقتصادی با توجه به شاخص‌های اجماع، پراکندگی و



شکل ۱- چارچوب منطقی سناریوهای آینده اقتصاد ایران

اقتصاد نفتی ایران، درآمد حاصل از افزایش صادرات نفت، زمینه فساد اقتصادی و رانت‌جویی بیشتر را فراهم می‌نماید. از آن‌جا که رانت‌جویی در رقابت با فعالیت‌های تولیدی از مزیت برخوردار است، لذا موجب انحراف فعالیت‌های کارآفرینی کمیاب مولد به سمت فعالیت‌های غیر مولد جهت کسب سود آسان‌تر می‌گردد. با ادامه این فعالیت‌های رانت‌جویانه و فساد ایجاد شده، زمینه برای گسترش دیوان‌سالاری نیز فراهم می‌گردد.

**پیامدهای امنیتی سناریو اول:** از جنبه امنیتی و با افزایش درآمدهای نفتی کشور به دلیل لغو تحریم‌های اقتصادی و افزایش قیمت نفت، بودجه نهادهای نظامی نیز افزایش می‌یابد. در این شرایط نهادهای نظامی امکان بیشتری برای خرید تسلیحات نظامی از خارج از مرزها و همچنین امکان تولید بیشتر تسلیحات در داخل کشور را به دست می‌آورد. این وضعیت منجر به تجهیز بیشتر و افزایش توان این نهادها در مبارزه با تهدیدات امنیتی داخلی و خارجی می‌شود. از سوی دیگر و با افزایش فروش نفت، میزان وابستگی کشورهای خارجی به تولیدات ایرانی افزایش می‌یابد. افزایش سطح وابستگی کشورهای دیگر به کالاهای استراتژیک ایران مانند نفت، گاز و محصولات کشاورزی، به صورت بالقوه عامل کاهش تهدیدات امنیتی بین‌المللی خواهد بود. در حوزه امنیت داخلی و در صورتی که با افزایش درآمدهای نفتی سیاست‌های تثبیت اقتصادی در ایران اعمال شود، رونق اقتصادی به تدریج در اقتصاد ایران حاکم می‌شود. این وضعیت ضمن افزایش رضایتمندی اقتصادی شهروندان، تهدیدهای امنیتی داخلی با منشاء اقتصادی را کاهش خواهد داد.

#### ۴-۴-۳- سناریو دوم: به سوی فانوس دریایی (رفع کامل تحریم‌های اقتصادی و کاهش قیمت نفت):

این سناریو ایرانی را ترسیم می‌کند که محدودیتی برای تعامل اقتصادی با دنیا ندارد ولی با محدودیت کاهش قیمت نفت مواجه است. در این شرایط و با کاهش قیمت نفت، درآمدهای نفتی دولت شروع به کاهش خواهد کرد. کاهش درآمدهای نفتی، دولت را با کسری بودجه مواجه می‌کند و به علت انعطاف‌ناپذیری هزینه‌های

#### ۴-۴-۲- سناریو اول: دروازه‌های بهشت (رفع کامل تحریم‌های اقتصادی و افزایش قیمت نفت)

این سناریو ایرانی را به تصویر می‌کشد که بدون وجود محدودیت بین‌المللی اقتصادی، امکان کسب درآمد بیشتر با افزایش قیمت نفت را دارد. به دلیل نحوه عملکرد اقتصادی دولت یازدهم بر مبنای اعمال سیاست‌های تثبیت اقتصادی و احتمال ادامه این سیاست‌ها در دولت دوازدهم، این چشم انداز در افق زمانی پنج سال آینده وجود دارد که سیاست‌ها و تغییرات اقتصادی زیر در صورت وقوع سناریو نخست در اقتصاد ایران رخ دهد.

لغو تحریم‌های اقتصادی و افزایش قیمت نفت درآمدهای نفتی دولت را افزایش داده و انتظار می‌رود این بودجه به جای افزایش بودجه جاری دولت وارد بودجه عمرانی و توسعه زیرساخت‌ها در اقتصاد ایران شود. چرا که این نوع هزینه کرد درآمدهای نفتی، دولت را جایگزین بخش خصوصی نکرده و بخش خصوصی را در تولید کالا و خدمات توانمندتر می‌سازد. با لغو محدودیت‌های تجاری بین‌المللی، امکان افزایش سرمایه‌گذاری داخلی و خارجی و ورود تکنولوژی به کشور نیز فراهم شده و کیفیت تولیدات داخلی افزایش می‌یابد. در نتیجه صادرات افزایش یافته و واردات کاهش می‌یابد و نرخ ارز شروع به کاهش می‌نماید. در کنار لغو تحریم‌های تجاری، لغو محدودیت‌های مالی و بانکی، ورود و خروج منابع ارزی را تسهیل نموده و بر سرعت توسعه می‌افزاید. رشد اقتصادی حاصل از این شرایط نرخ بیکاری را کاهش می‌دهد و با جابجایی نیروی کار از بخش دولتی به بخش خصوصی، زمینه کوچک‌تر شدن دولت ایجاد می‌شود. از سوی دیگر و با لغو تحریم‌های اقتصادی، امکان سرمایه‌گذاری بین‌المللی در صنایع نفت ایران فراهم شده و شرایط فروش بیشتر نفت نیز ایجاد می‌شود. قابل ذکر است که با افزایش فعالیت‌های مولد بخش خصوصی، درآمدهای مالیاتی دولت نیز افزایش یافته و دولت می‌تواند ضمن تامین بودجه جاری خود از طریق اخذ مالیات بیشتر، اثر نوسانات قیمت نفت بر بودجه را نیز کنترل نماید. در کنار تاثیر مستقیم افزایش درآمدهای نفتی بر رشد اقتصادی، یکی از کلیدی‌ترین مکانیزم‌های اثرگذاری آن در ایران تاثیر بر متغیرهای نهادی است. در

می‌شود. بنابراین توان نظامی به ویژه به لحاظ سخت‌افزای نیز با افت همراه خواهد شد که به دنبال آن توان مقابله با تهدیدهای امنیتی نیز کاهش می‌یابد. از سوی دیگر و با کاهش قیمت نفت، سازمان اوپک که ایران نیز نفت خود را در قالب این سازمان به فروش می‌رساند سیاست کنترل حجم تولید را در پیش می‌گیرد. کاهش حجم تولید میزان وابستگی کشورهای غربی به نفت ایران را کاهش داده و امکان تهدید امنیتی به دلایل مختلف را بالا می‌برد. در مقابل و همانطور که پیش از این نیز بیان شد بخش خصوصی توانمندتر می‌تواند بخشی از این تهدیدها را از طریق افزایش صادرات کنترل نماید. بخش خصوصی با توجه به عدم وجود محدودیت تجاری و مالی بین‌المللی امکان سرمایه‌گذاری، تولید و صادرات به دست می‌آورد. در این شرایط میزان واردات کالا از ایران و توسط کشورهای منطقه افزایش خواهد یافت و سطح وابستگی به اقتصاد ایران را بالا خواهد برد. با افزایش وابستگی منطقه ای به محصولات ایرانی، این انتظار می‌رود که تهدیدهای امنیتی علیه ایران در منطقه کاهش یابد. در حوزه امنیت داخلی و با توجه به اتخاذ سیاست‌های انقباضی توسط دولت، می‌توان انتظار داشت که تورم در اقتصاد ایران کنترل خواهد شد و ثبات نسبی در اقتصاد ایران حاکم می‌شود. از سوی دیگر بیکاری نیز به دلیل کاهش تقاضای کل، رشد خواهد نمود که رشد بیکاری می‌تواند به عنوان یک تهدید امنیتی بالقوه عمل کند.

#### ۴-۴-۴ سناریو سوم: سفر به انتهای شب (کاهش قیمت نفت و عدم رفع تحریم‌ها و اعمال تحریم‌های جدید):

این سناریو از بین چهار سناریو محتمل از آینده اقتصاد ایران سخت‌ترین شرایط اقتصادی را برای ایران به همراه خواهد داشت. در این شرایط علاوه بر این که قیمت نفت به عنوان منبع اصلی درآمد ایران با کاهش همراه می‌شود، امکان فروش نفت به دلیل افزایش تحریم‌های اقتصادی نیز کاهش خواهد یافت. با وقوع این سناریو، تحریم‌های اقتصادی ایران در دو حوزه تجاری و مالی نه تنها لغو نخواهد شد، بلکه به طرق دیگر افزایش

جاری که بخش عمده آن مربوط به حقوق و دستمزد کارکنان دولتی است، هزینه‌های عمرانی به سرعت کاهش یافته و منابع آن به سمت هزینه‌های جاری سوق داده می‌شوند. بنابراین اولین اثر آن ظهور انبوهی از طرح‌های نیمه‌تمام در بخش عمرانی و زیربنایی است که سبب بروز رکود و بیکاری به خصوص در بخش‌هایی می‌شود که عمدتاً از کارگران غیرماهر استفاده می‌کنند. با کاهش قیمت نفت و درآمدهای نفتی این فرصت در اقتصاد ایران ایجاد می‌شود که با عبور از نفت، اثر این ماده طبیعی در اقتصاد ایران را کم‌رنگ‌تر کند. در این شرایط دولت برنامه‌های سالانه بودجه کشور را انقباضی تنظیم خواهد کرد تا نیازمند استقراض از نهادهای داخلی و خارجی و به ویژه بانک مرکزی نباشد. کاهش استقراض از بانک مرکزی و همچنین کاهش مخارج دولت، سطح تقاضای کل را با کاهش مواجه می‌کند. در نتیجه تورم کنترل شده اما تولید و اشتغال نیز در شرایط رکودی قرار خواهند گرفت. در این وضعیت دولت سعی خواهد کرد تا با کاهش محدودیت‌های فضای کسب و کار و همچنین ریسک سرمایه‌گذاری در کشور، سرمایه‌گذاری داخلی و خارجی را افزایش دهد. افزایش سرمایه‌گذاری بخش خصوصی با افزایش تولید، اشتغال و جانشینی به جای دولت، این امکان را برای دولت فراهم می‌کند که با افزایش درآمدهای مالیاتی کسری بودجه ناشی از کاهش قیمت نفت را نیز جبران نماید. از سوی دیگر و با لغو کامل تحریم‌های اقتصادی، امکان تجارت و سرمایه‌گذاری خارجی نیز افزایش خواهد یافت. سرمایه‌گذاری خارجی از طریق ایجاد اشتغال، انتقال تکنولوژی تولید، تقویت و گسترش منابع مالی و بین‌المللی و افزایش بهره‌وری بر عملکرد اقتصاد ایران به دلیل وجود محدودیت در موجودی سرمایه کشور بسیار تاثیرگذار است.

**پیامدهای امنیتی سناریو دوم:** با کاهش قیمت نفت و به دنبال آن کاهش درآمدهای نفتی، بودجه در اختیار نهادهای نظامی نیز به تبعیت از کاهش بودجه دولت کم می‌شود. در این شرایط امکان خرید تسلیحات نظامی و سرمایه‌گذاری در تولید تسلیحات در داخل کشور برای ارگان‌های نظامی کاهش خواهد یافت و همچنین بودجه جاری این نهادها نیز با محدودیت مواجه

مواجه می‌شود که حتی ممکن است به رفتارهای رمه‌ای در خروج سپرده‌ها نیز تبدیل شود.

#### پیامدهای امنیتی سناریو سوم: در صورت وقوع

این سناریو، اثرات امنیتی آن نیز ملموس و قابل توجه خواهد بود. از این رهگذر دریافتی‌های بودجه‌ای نهادهای نظامی از بودجه عمومی کشور با کاهش جدی روبرو خواهد شد. نتیجه چنین شرایطی، کاهش توان این نهادها در خرید و تولید تجهیزات و ادوات نظامی و به دنبال آن کاهش توان این سازمان‌ها در مقابله با تهدیدهای امنیتی است. با وقوع این سناریو محتمل است که هزینه‌های نظامی اختصاص یافته از بودجه عمومی، به دلیل وجود تنش سیاسی و نظامی در منطقه کاهش نیابد. دولت برای جبران هزینه‌های نظامی اختصاص یافته به حوزه‌های نظامی، ناچار به کاهش جدی هزینه‌های خود در دیگر بخش‌های اقتصادی مانند بهداشت درمان و آموزش است. علاوه بر مورد فوق، در صورتی که دولت امکان فروش نفت را به دلیل وضع تحریم‌ها از دست دهد، وابستگی اقتصادی کشورهای فرامنطقه‌ای به اقتصاد ایران را نیز از دست خواهد داد. بنابراین، انتظار می‌رود که سطح تهدیدهای امنیتی این کشورها به دلیل عدم وجود عامل بازدارنده نفت در مواقعی که تنش سیاسی وجود دارد، افزایش یابد. علاوه بر این، اعمال تحریم‌های جدید که بخشی از آن‌ها مرتبط با فروش تسلیحات نظامی به ایران خواهد بود نیز می‌تواند ضمن افزایش اعتماد به نفس این کشورها به تهدیدهای امنیتی بر توان دفاعی ایران تاثیر منفی داشته باشد. از سوی دیگر و با کاهش امکان تجارت با کشورهای منطقه و همسایگان به دلیل وضع تحریم‌های اقتصادی، میزان وابستگی این کشورها به ایران در زمینه اقتصادی با کاهش همراه خواهد شد. با کاهش وابستگی این کشورها به اقتصاد ایران و همچنین افزایش وابستگی ایران به این کشورها، به نظر می‌رسد که این کشورها در صورت وجود تنش‌های سیاسی، تهدید امنیتی یا سیاسی بالقوه برای ایران به شمار می‌روند. با وقوع سناریو سوم، حوزه امنیت داخلی نیز شرایط متفاوت‌تری از حوزه امنیت بین‌الملل نخواهد داشت. چرا که وقوع بی‌ثباتی اقتصادی، رکود تورمی و یا رکود اقتصادی ناشی از این سناریو نارضایتی عمومی از نحوه اداره کشور را

نیز می‌یابد. تحریم‌های تجاری از طریق محدود کردن یا قطع صادرات و واردات کالاها و تحریم‌های مالی از طریق ایجاد محدودیت و فشار بر روابط مالی بین‌المللی ایران عمل خواهند کرد. در این شرایط نه تنها دست دولت در برنامه‌ریزی برای توسعه خالی خواهد شد، بلکه امکان رشد و توسعه از بخش خصوصی نیز گرفته می‌شود. دولت که با کسری بودجه مواجه است، در این شرایط در موقعیت دوگانه استقرای از بانک مرکزی یا اتخاذ سیاست مالی انقباضی قرار می‌گیرد. در صورت حرکت دولت به سمت سیاست‌های پولی انبساطی به جای کاهش هزینه، نرخ تورم به صورت گسترده‌ای افزایش خواهد یافت. نرخ ارز نیز به دلیل کاهش عرضه ارز ناشی از فروش نفت و افزایش سطح عمومی قیمت‌ها به صورت افسارگسیخته افزایش خواهد یافت. در مجموع بی‌ثباتی در اقتصاد حاکم شده و نارضایتی عمومی به شدت افزایش خواهد یافت. از سوی دیگر و در صورت اتخاذ سیاست‌های مالی انقباضی نظیر کاهش مخارج دولت و افزایش مالیات توسط دولت نیز تقاضای کل با کاهش مواجه می‌شود. این سیاست ممکن است مانع از افزایش تورم شود، اما قادر نخواهد بود که از تضعیف بخش خصوصی جلوگیری نماید. چرا که کاهش تقاضای کل و افزایش مالیات، سوددهی بنگاه‌های اقتصادی خصوصی را کاهش داده و انگیزه سرمایه‌گذاری خصوصی را از بین می‌برد. اعمال و تشدید تحریم‌های بین‌المللی اقتصادی در این سناریو، ورود سرمایه مستقیم و غیرمستقیم خارجی به ایران را نیز به شدت متاثر نموده و آن را کاهش داده یا مسدود می‌نماید. علاوه بر موارد فوق، وضع محدودیت‌های مالی و بانکی، ورود درآمدهای ارزی به ویژه درآمدهای نفتی را نیز با چالش جدی روبرو خواهد کرد. بر این اساس، تنها امکان فروش محدود نفت ایران در مقابل واردات کالاهای ضروری مانند غذا یا دارو وجود خواهد داشت و در صورتی که دولت امکان فروش نفت در مقابل دریافت ارز را داشته باشد، این امکان از مبادی غیر رسمی و با افزایش قابل ملاحظه هزینه‌های مبادله و فعالیت‌های سوداگرانه همراه خواهد شد. قابل ذکر است که با وقوع این سناریو، نظام بانکی نیز با افزایش معوقات بانکی روبرو شده و در بازپرداخت دیون خود با مشکل

درآمدهای مالیاتی تغییر خواهد داد. این سیاست فشار مضاعفی به بخش خصوصی که به دلیل محدودیت‌های تجاری امکان تولید و صادرات کالا مانند گذشته را ندارد وارد خواهد نمود. بخش خارجی نیز علی‌رغم تمایل به سرمایه‌گذاری در ایران به دلیل وجود استعدادها بالقوه در منابع طبیعی و نیروی کار ماهر، امکان این کار را به دلیل ممنوعیت‌های مراوده اقتصادی با ایران نخواهد داشت. بنابراین حجم سرمایه در ایران که به دلیل عدم تکافوی سرمایه دولتی و بخش خصوصی، برای جهش اقتصادی نیازمند سرمایه‌گذاری خارجی است، با کاهش مواجه خواهد شد. قابل ذکر است که وقوع این سناریو ممکن است منجر به افزایش معوقات بانکی شود که نظام بانکی یا بخشی از آن را با خطر ورشکستگی همراه می‌کند.

**پیامدهای امنیتی سناریو چهارم:** در این سناریو و به رغم افزایش قیمت نفت، امکان صادرات نفت از ایران گرفته می‌شود و با کاهش بودجه دولت، نهادهای نظامی نیز بخشی از بودجه سالانه خود را از دست می‌دهد تا به این وسیله امکان توسعه فعالیت‌های امنیتی، خرید تجهیزات و تولید تسلیحات توسط این نهادهای نظامی محدود شود. در این سناریو نیز محتمل است که بودجه نظامی کلیه نهادهای نظامی به دلیل وجود بحران‌های سیاسی خاورمیانه نه تنها با کاهش همراه نبوده، بلکه افزایش نیز یابد. دولت در راستای تامین هزینه‌های نظامی مطرح شده، ناچار به کاهش هزینه‌های خود در دیگر بخش‌های اقتصادی است. مانند قبل و در صورتی که دولت امکان فروش نفت را به دلیل وضع تحریم‌های از دست دهد، وابستگی کشورهای واردکننده نفت نسبت به اقتصاد ایران کاهش یافته و انتظار می‌رود که سطح تهدیدهای امنیتی آن‌ها نیز افزایش یابد. علاوه بر این و به دلیل اعمال تحریم در فروش تسلیحات نظامی به ایران، نهادهای نظامی در تجهیز خود با چالش‌هایی روبرو خواهد شد که این مساله هزینه‌های مبادله را به شدت افزایش خواهد داد. تحریم‌های اقتصادی موانع جدی در مقابل صادرات کالا به کشورهای منطقه ایجاد خواهد کرد و میزان وابستگی ایران به این کشورها به دلیل وجود مرزهای مشترک آبی و خاکی را افزایش می‌-

افزایش می‌دهد که این نارضایتی‌های عمومی در ادامه می‌تواند به شکل‌های مختلف به تهدید امنیتی بدل شود. قابل ذکر است که علاوه بر مورد فوق در ایجاد ناامنی، افزایش چالش‌های دولت در تامین کالاهای ضروری و همچنین کاهش بودجه بهداشت، درمان و آموزش به دلیل تثبیت یا افزایش بودجه نظامی نیز می‌تواند به عامل ناامنی در ایران بدل شود.

#### ۴-۵- سناریو چهارم: بر باد رفته (افزایش قیمت نفت و عدم رفع تحریم‌ها و اعمال تحریم‌های جدید):

با وقوع عدم قطعیت‌های این سناریو، علی‌رغم افزایش جهانی قیمت نفت، تحریم‌های اقتصادی مانع از کسب درآمد نفتی توسط دولت خواهد شد. چرا که قیمت نفت عامل تعیین‌کننده صادرات نفت خام ایران در این سناریو نبوده و عدم امکان صادرات نفت است که نقش اصلی را بازی می‌کند. در این وضعیت تحریم‌های تجاری مانع از صادرات نفت و تحریم‌های مالی مانع از ورود ارز حاصل از فروش رسمی نفت به داخل مرزهای کشور می‌شوند. چنین شرایطی برای دیگر کالاها و به ویژه مواد اولیه و کالاهای نیمه‌ساخته مورد استفاده در تولید داخل نیز وجود دارد و حتی در صورت تولید کالا، امکان صادرات محصول نهایی به شدت کاهش خواهد یافت. بنابراین با وقوع این سناریو حجم تجارت خارجی ایران کاهش خواهد یافت و انتظار می‌رود که نرخ ارز افزایش یابد. دولت با این سناریو عاجز از تامین کامل بودجه سالانه است و لذا بودجه عمرانی را کاهش می‌دهد تا هزینه‌های جاری را تامین نماید. با توجه به نحوه رفتار اقتصادی دولت یازدهم و انتظار از دولت برای ادامه همین سیاست‌های اقتصادی در دولت دوازدهم، دولت استقراض بی‌رویه از بانک مرکزی را به عنوان خط قرمز خود در نظر خواهد گرفت. یعنی علی‌رغم اعمال سیاست‌های پولی انبساطی به منظور رفع بخشی از کسری بودجه خود، سیاست‌های پولی انبساطی لجام گسیخته را در پیش نخواهد گرفت. بنابراین نرخ تورم تثبیت شده و یا افزایش ناچیزی خواهد داشت. همچنین دولت در ادامه سیاست‌های مالی انقباضی خود، الگوی اخذ مالیات را در راستای افزایش



استخراج متغیرهای غیرقطعی بحرانی از بین متغیرهای ذکر شده، از پرسشنامه‌های تکمیل شده توسط خبرگان اقتصادی استفاده شد. بر اساس نتایج حاصل از تحلیل پرسشنامه‌ها، دو عدم قطعیت تحریم‌های اقتصادی و قیمت نفت به عنوان عدم قطعیت‌های بحرانی اقتصاد ایران انتخاب شدند. در نهایت و از تلاقی دو عدم قطعیت بحرانی قیمت نفت و تحریم‌های اقتصادی بین‌المللی، چهار فضای سناریویی از آینده اقتصاد ایران ایجاد شد که حاصل تلفیق دو حالت حدی افزایش قیمت نفت و لغو تحریم‌های اقتصادی، کاهش قیمت نفت و لغو تحریم‌های اقتصادی، کاهش قیمت نفت و عدم لغو تحریم‌های اقتصادی، افزایش قیمت نفت و عدم لغو تحریم‌های اقتصادی است.

از بین چهار سناریو روبروی اقتصاد ایران، در سه سناریو اقتصاد ایران با مشکلاتی مواجه خواهد شد و تنها سناریو اول می‌تواند شرایط جهش اقتصادی ایران را فراهم نماید. برای نمونه در سناریوهای دوم تا چهارم، درآمدهای نفتی کشور که مهم‌ترین منبع تامین مالی اقتصاد ایران شناخته می‌شود با کاهش روبرو شده و کسری بودجه دولت را با خود به همراه می‌آورد و به دنبال آن هزینه‌های عمرانی و زیربنایی را کاهش می‌دهد. به ویژه تحریم‌های اقتصادی در سناریو سوم و چهارم، فروش نفت و ورود و خروج سرمایه و کالا را با مانع جدی مواجه کرده و هزینه‌های مبادله را بالا می‌برد. از نقطه نظر امنیتی نیز به نظر می‌رسد که تنها سناریو نخست قادر به کاهش مشکلات امنیتی با منشاء داخلی و خارجی باشد. در حالی که در هر سه سناریو دیگر و به فراخور تغییرات صورت گرفته در اقتصاد، کشور ایران و نهادهای نظامی ممکن است با مشکلات امنیتی منطقه‌ای، فرامنطقه‌ای و داخلی روبرو شوند.

#### فهرست منابع

۱) ابریشمی، حمید و مهرآرا، محسن و تمدن‌نژاد، علیرضا (۱۳۸۸). بررسی رابطه تجارت خارجی و رشد اقتصادی در کشورهای در حال توسعه: روش گشتاورهای تعمیم یافته. مجله دانش و توسعه، سال شانزدهم، شماره ۲۶، بهار، صص ۴۴-۶۱.

دهد. بنابراین با کاهش وابستگی این کشورها به ایران و افزایش وابستگی ایران به این کشورها، در مواقع بروز تنش‌های سیاسی، این کشورها به تهدیدهای بالقوه امنیتی تبدیل خواهند شد. در زمینه امنیت داخلی نیز کاهش درآمدهای دولتی، کاهش تولید ملی، افزایش بیکاری، وجود تورم، مشکلات تامین نیازهای ضروری مانند غذا و دارو می‌تواند با دامن زدن به نارضایتی‌های اجتماعی و ایجاد عدم ثبات سیاسی، ناامنی عمومی را افزایش دهد.

#### ۵- خلاصه و جمع‌بندی

مطالعه روندهای گذشته اقتصاد ایران، شناسایی عوامل کلیدی تاثیرگذار بر آن، شناسایی برخی از عوامل احتمالی تاثیرگذار بر آینده اقتصادی ایران و استفاده از این عوامل در راستای شناسایی برخی از آینده‌های ممکن اقتصاد ایران مساله عملی مطرح در این پژوهش بود. برای پاسخ به این مساله و با توجه به ناشناخته بودن آینده، از بافت علمی آینده پژوهانه به روش سناریونگاری استفاده شد. سناریونگاری روش بسیار موثر و مفیدی برای برنامه‌ریزی میان‌مدت و بلندمدت در شرایط عدم قطعیت است. یکی از شناخته‌شده‌ترین رهیافت‌ها در سناریونگاری روش عدم قطعیت‌های بحرانی است که به منظور نگارش سناریوهای محتمل آینده اقتصاد ایران از این روش استفاده شد. رهیافت سناریونگاری با رویکرد عدم قطعیت بحرانی با استفاده از تعداد محدود عدم قطعیت اقتصادی، امکان ارائه سناریوهای محتمل از اقتصاد ایران را فراهم می‌نماید.

جهت نگارش سناریوهای آینده اقتصاد ایران با استفاده از رویکرد عدم قطعیت بحرانی، شناسایی نیروهای پیشران همراه با عدم قطعیت در اقتصاد ایران و همچنین شناسایی نیروهای دارای عدم قطعیت بحرانی از میان آن‌ها، گام‌های کلیدی در این روش محسوب می‌شوند. به همین منظور و در قدم اول، روند حرکتی مهم‌ترین متغیرهای اقتصادی تاثیرگذار بر اقتصاد ایران با استفاده از مرور ادبیات مورد مطالعه و ارزیابی قرار گرفت و با توجه به نحوه تغییرات این متغیرها، یازده متغیر همراه با عدم قطعیت شناسایی شد. در ادامه و به منظور

- (۲) اشرافی بفرئی، مزده (۱۳۹۵). تحلیل سازوکارهای همکاری نهادهای توسعه فناوری با رویکرد آینده پژوهانه. پایان نامه کارشناسی ارشد، دانشگاه اصفهان.
- (۳) بهبودی، داود و اصغرپور، حسین و بهشتی، محمد باقر و محمدلو، نویده (۱۳۹۰). مقایسه نقش کیفیت نهادی بر بلای منابع طبیعی در بین کشورهای صادر کننده نفت خام، پژوهشنامه علوم اقتصادی، سال ششم، شماره ۱۱، صص ۸۰-۶۱.
- (۴) حافظی حامد (۱۳۹۳). بررسی نقش سیستم بانکی بر سرمایه‌گذاری بخش خصوصی در ایران. فصلنامه روند، سال بیست و یکم، شماره ۶۸، زمستان، صص ۸۷-۱۲۰.
- (۵) حیدری، حسن و علی‌نژاد رقیه (۱۳۹۳). بررسی تاثیر متغیر نهادی حاکمیت قانون بر رشد اقتصادی در هشت کشور بزرگ اسلامی. دانشنامه حقوق اقتصادی، دوره جدید، سال بیست و یکم، شماره ۵، بهار و تابستان.
- (۶) حیدری، حسن و اصغری، رعنا و علی‌نژاد، رقیه (۱۳۹۴). بررسی اثربخشی دولت بر نرخ تورم در کشورهای منتخب منطقه MENA. فصلنامه پژوهشنامه اقتصادی، سال پانزدهم، شماره ۵۷، تابستان ۱۳۹۴، صص ۱۹۲-۱۶۵.
- (۷) دادگر، یداله و نظری، روح‌اله و صیامی عراقی، ابراهیم (۱۳۹۲). دولت و مالیات بهینه در اقتصاد بخش عمومی و کارکرد دولت و مالیات در اقتصاد ایران. فصلنامه مطالعات اقتصادی کاربردی ایران، سال دوم، شماره ۵، بهار، صص ۲۹-۱.
- (۸) سپهر دوست، حمید و برجیسیان، عادل (۱۳۹۵). بررسی اثرات غیرمستقیم فساد بر رشد اقتصادی با تاکید بر شاخص ادراک فساد. فصلنامه اقتصاد مقداری، دوره ۱۳، شماره ۱، بهار، صص ۲۹-۱.
- (۹) سلمانی، بهزاد، و بهبودی، داود و اصغرپور، حسین و ممی‌پور، سیاب (۱۳۹۱). اثر بی‌ثباتی درآمدهای نفتی بر رشد اقتصادی ایران با تاکید بر حساب ذخیره ارزی. پژوهشنامه اقتصاد کلان، سال هفتم، شماره ۱۴، نیمه دوم ۱۳۹۱.
- (۱۰) شاه آبادی، ابوالفضل و دهقانی احمدآباد، هانی (۱۳۸۹). تاثیر عوامل نهادی بر رشد اقتصادی کشورهای عضو گروه D8. فصلنامه اقتصاد و تجارت نوین، شماره‌های ۲۱ و ۲۲، تابستان و پاییز، صص ۴۹-۷۵.
- (۱۱) شاه آبادی، ابوالفضل و بهاری، زهره (۱۳۹۳). تاثیر ثبات سیاسی و آزادی اقتصادی بر رشد اقتصادی کشورهای منتخب توسعه یافته و در حال توسعه. فصلنامه پژوهش‌های رشد و توسعه اقتصادی، سال چهارم، شماره شانزدهم، پاییز.
- (۱۲) عباسیان، عزت‌الله و مرادپور اولادی، مهدی و مهرگان، نادر (۱۳۹۱). تاثیر عدم اطمینان نرخ ارز واقعی بر رشد اقتصادی. مجله تحقیقات اقتصادی، شماره ۹۸، بهار، صص ۱۶۹-۱۵۳.
- (۱۳) صمدی، سعید و یحیی، آبادی ابوالفضل و معلمی، نوشین (۱۳۸۸). تحلیل تاثیر شوک‌های قیمتی نفت بر متغیرهای اقتصاد کلان ایران. فصلنامه پژوهش‌ها و سیاست‌های بازرگانی اقتصادی، سال هفدهم، شماره ۵۲، زمستان، صص ۲۶-۵.
- (۱۴) طاهری فرد، احسان و موسوی آزاد کسمایی، افسانه (۱۳۸۷). اثربخشی سیاست پولی بر متغیرهای کلان اقتصادی در ایران. مجله تحقیقات اقتصادی، دوره ۴۳، شماره ۸۳، تابستان، صص ۱۶۱-۱۳۷.
- (۱۵) علیزاده، عزیز و وحیدی مطلق، وحید و ناظمی، امیر (۱۳۸۷). سناریونگاری یا برنامه‌ریزی بر پایه سناریوها. اندیشگاه آتی نگار
- (۱۶) کریمی پور، داود (۱۳۹۳). ظرفیت‌های دیپلماسی انرژی جمهوری اسلامی ایران در جنگ اقتصادی. مجله پدافند اقتصادی، شماره ۱، آذر، صص ۴۱-۳۷.
- (۱۷) کمیجانی، اکبر (۱۳۹۲). اقتصاد سیاسی رشد اقتصادی. فصلنامه پژوهش‌ها و سیاست‌های اقتصادی، سال ۲۱، شماره ۶۵، بهار، صص ۸۲-۶۱.
- (۱۸) مهرگان، نادر و سپه‌بان قره‌بابا (۱۳۹۲). اثرات کوتاه-مدت و بلندمدت مخارج دولت و تورم بر سرمایه-گذاری بخش خصوصی در ایران. فصلنامه برنامه و بودجه، سال هجدهم، شماره ۲، تابستان، صص ۲۲-۳.

- ۱۹) هادیان، ابراهیم و تحویلی، علی (۱۳۹۳). تاثیر نوسانات سیاست‌های مالی بر سرمایه‌گذاری بخش خصوصی در ایران. مطالعات اقتصاد کاربردی ایران، سال سوم، شماره ۱۲، زمستان، صص ۹۱-۱۱۰.
- 20) Ferraro, G. (1998). The Cultural Dimension of International Business. 3rd Edition. New Jersey: Prentice Hall.
- 21) Furubotn, E. G., & Richter, R. (2000). Institutions and economic theory: The contribution of the new institutional economics. Ann Arbor, MI: The University of Michigan Press.
- 22) Heritage Foundation (2017). Index of Economic Freedom. <http://www.heritage.org/index/explore?view=by-region-country-year>
- 23) International property rights index (2017).
- 24) Naderimanesh, M., Shammaee, A., Ghadiri, R., & Nazemi, A. (2009). INFORMATION TECHNOLOGY FORESIGHT: IRAN 2025. National Research Institute for Science Policy.
- 25) Stiglitz, Joseph (2002). Globalization and its Discontents. W. W. Norton & Company
- 26) Van der Ploeg, Rick (2010). Natural Resources: Curse or Blessing? CESifo Working Paper Series, No. 3125.
- 27) International monetary fund (IMF) (2016). World Economic Outlook, Too Slow for Too Long. <http://www.imf.org/external/pubs/ft/weo/2016/01/pdf/text.pdf>

#### یادداشت‌ها

<sup>1</sup> International Monetary Fund

<sup>2</sup> World Bank

<sup>3</sup> Stiglitz

<sup>4</sup> Ferraro

<sup>5</sup> Heritage Foundation

<sup>6</sup> Furubotn

<sup>7</sup> Richter

<sup>8</sup> International Property Rights Index

<sup>9</sup> Critical Uncertainty

<sup>10</sup> Peter Schwartz

<sup>11</sup> Global Business Network (GBN)

## Research on Iran's Economic Future Scenarios and Its Security Impacts: Critical Uncertainty Approach

**Hossein Esmacili Razi**

Ph.D. in Economics, University of Isfahan, Assistant Professor, Non-profit Higher Education Institution of Isfahan  
(Corresponding Author)  
h.esmaeili.r@gmail.com

**Alireza Nasr Esfahani**

Ph.D. Student, Future Studies, Research Center for National Science Policy

### Abstract

Studying and planning to achieve a better economic future, plays an important role in the thinking of economic policymakers in every country, including Iran. But the achievement to the desirable and sustainable future requires answering these questions that the Iran's economy has been influenced by what factors and policies? And what factors determine the future trend of Iran's economy? Accordingly, in this research, the study on past trends of the Iran's economy and the identification of factors that affecting the Iran's economy have been considered, in order to write the scenarios for the Iran's future economy and its security impacts. For this purpose, critical uncertainty approach were used. To write the future scenarios, Iran's economic factors with critical uncertainty were identified by using questionnaires that completed by economic experts. Accordingly, two uncertainties of "international economic sanctions" and "oil price" were selected as the critical uncertainties.

Based on the results of these scenarios, the Iran's economy will face a decline in economic growth in three scenarios, and in only one scenario, conditions for economic growth and development will be provided without a serious impediment. From a security point of view, in three scenarios and due to changes in the economy, Iran will face security problems with regional, transnational and internal sources.

**Keywords:** oil price, economic sanctions, critical uncertainty, scenario