فصلنامه پژوهشهای سیاسی جهان اسلام، سال هشتم، شماره دوم، تابستان ۱۳۹۷، صص ۹۳ - ۸۱

DOI: ۱۰.۲۱۸۵۹/priw-۰۸۰۲۰۴

مطالعه خطرات ژئوپلیتیک جهانی در سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی نظام جمهوری اسلامی ایران

ولی محمد درینی[1]
استادیار گروه مدیریت دانشگاه پیام نور تهران
احسان نامدار جویمی[2]
دانشجوی دکتری مدیریت منابع انسانی دانشگاه سیستان و بلوچستان (نویسنده مسئول)

تاریخ دریافت: ۱۳۹۶/۱۱/۱۷ **تاریخ پذیرش:** ۱۳۹۷/۰۲/۲۵

انجمن مطالعات جهان اسلام
Islamic World Studies Association
جمعية دراسات العالم الاسلامي
فصلنامه علمی -پژوهشی
پژوهشهای سیاسی جهان اسلام

چکیده

در این مقاله، به بررسی شوک‌ها و خطرات ژئوپلیتیک جهانی (ایالات‌متحده امریکا) و نقش مهمی که در سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی در نظام جمهوری اسلامی ایران بازی می‌کند، می‌پردازیم. ما واریانس مدل‌های ساختاری را برای کشور تخمین زدیم. نتایج نشان‌دهنده آن است که شوک‌های جغرافیایی سیاسی، سهم غیرقابل توجهی از تنوع تولید در نظام جمهوری اسلامی ایران را توضیح می‌دهد. میانگین سهم جنبش‌های خروجی که به دلیل شوک‌های خطر جهانی ژئوپلیتیکی محسوب می‌شود، بین ۱۳ تا ۲۲ درصد است. بااین‌حال، پاسخ‌های ضربه‌ای به شوک‌های ژئوپلیتیک به‌طور گسترده در نظام جمهوری اسلامی ایران متفاوت است. نتایج اولیه نشان می‌دهد که افزایش غیرمنتظره در خطرات ژئوپلیتیکی باعث کاهش تولید واقعی، مصرف و سرمایه‌گذاری می‌شود. به‌طور خاص، میزان پیک مصرف و سرمایه‌گذاری به ترتیب ۰/۸ و ۲/۲ درصد است. نرخ ارز واقعی با بیش از دو درصد کاهش همراه است (بهبود تعادل تجاری در حدود ۰,٤ درصد است). به‌طورکلی، متوسط خروجی تقریباً یک درصد کاهش می‌یابد. نتیجه این‌که خطر ژئوپلیتیک افزایش‌یافته منجر به کاهش واقعی نرخ ارز می‌شود و نشان می‌دهد که کشورهای در حال ظهور پس از شوک ریسک ژئوپلیتیک شاهد سرمایه‌گذاری هستند. تعادل تجارت هنگامی‌که نرخ واقعی ارز کاهش می‌یابد، بهبود می‌یابد، اما بهبود به‌اندازه کافی بزرگ نیست که تأثیر بر مصرف و سرمایه‌گذاری را تعیین کند.

واژه‌های کلیدی: خطرات ژئوپلیتیک جهانی، سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی، نظام جمهوری اسلامی ایران، ایالات متحده امریکا.

1. vm.darini@yahoo.com
2. davood.joyame@gmail.com

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

مقدمه

خطرات ژئوپلیتیکی اغلب به‌عنوان مقدمه‌ای بر تغییرات در چرخه‌های تجاری در نظر گرفته می‌شود. به نظر می‌رسد اقتصادهای نوظهور آسیب‌پذیرتر به تغییرات ناگهانی در تجارت و سرمایه می‌باشند که می‌تواند به دلیل وقوع خطرات ژئوپلیتیکی باشد. عدم اطمینان ژئوپلیتیک شدید می‌تواند موجب مصرف بیشتر و یا به تأخیر افتادن مصرف سریع شود (Bloom 2009). ژئوپلیتیک مفهومی است که از تلفیق سیاست با جغرافیا به دست میآید. موقعیتهای جغرافیایی ویژه که مختص مناطق مشخصی از جهان است، امتیازاتی را برای ساکنان آن مناطق به وجود میآورد که در صورت پیوند با عوامل فرهنگی، سیاسی و اقتصادی میتواند به عامل مهم قدرت تبدیل شود(کشاورز شکری و فهیمی، ۱۳۹۶). امروزه خاورمیانه به صحنه نبردهای ایدئولوژیک و ژئوپلیتیک میدانهای منطقهای و کنش حداکثری کارگزاران ژئوپلیتیک و سیستمهای دوفاکتو آنها در میدانهای محاط بر آنها تبدیل شده است(حاتمی ، ۱۳۹۶).

برای بررسی و مطالعه خطرات ژئوپلیتیک جهانی، شاخص ریسک ژئوپلیتیکی را که توسط کالاردا و ایاکویولو (۲۰۱۸) ایجادشده است، اتخاذ می‌کنیم و بر اساس آن سیاست‌های های اقتصادی در نظام جمهوری اسلامی ایران مطالعه می‌شود. این شاخص با شمارش تعداد دفعاتی که کلمات مربوط به تنش‌های ژئوپلیتیکی در روزنامه‌های برتر بین‌المللی ظاهر می‌شوند، ساخته‌شده است. این‌ها شامل جنگ، وقایع تروریستی و تنش‌های سیاسی است که روابط داخلی و بین‌المللی را تحت تأثیر و فشار می‌گذارد. سپس این شاخص را به یک مدل VAR ساختاری برای جمهوری اسلامی ایران با اقتصادی در حال توسعه اعمال می‌کنیم. شوک‌های ساختاری به علت ریسک ژئوپلیتیک از طریق تجزیه چولسکی از مدل‌های دیگر به‌دست‌آمده است. در این پژوهش، مطالعات شیمیت گرو و اوبری (۲۰۱۷) را دنبال می‌کنیم و سیاست‌های اقتصادی نظام جمهوری اسلامی را بر مبنای آن در نظر می‌گیریم.

نتایج پژوهش‌ها نشان می‌دهد که خطرات ژئوپلیتیک جهانی با سقوط اقتصادی قابل‌توجه در کشورهایی با اقتصاد درحال‌توسعه از جمله نظام جمهوری اسلامی ایران مرتبط است. واکنش‌های مخرب مداخله در اقتصاد کشور نشان می‌دهد که نسبت مصرف و سرمایه‌گذاری پس از یک شوک انحراف استاندارد به شاخص ریسک ژئوپلیتیک کاهش می‌یابد. شوک‌های جغرافیایی و سیاسی موجب کاهش ارزش واقعی نرخ ارز می‌شود که منجر به بهبود تعادل

فصلنامه علمی -پژوهشی
پژوهشهای سیاسی جهان اسلام

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

تجاری می‌شود. بااین‌حال، تولید به‌طور متوسط کاهش می‌یابد. شوک‌های خطر ژئوپلیتیک بخش مهمی از زوایای کسب‌وکار در کشور(جمهوری اسلامی ایران) را تشکیل می‌دهند.

کار پژوهشی بلوم (۲۰۰۹) نشان می‌دهد که عدم اطمینان، سرمایه‌گذاری را عمدتاً از طریق تغییر در گسترش اعتبار تغییر می‌دهد. بیکر، بلوم و دیویس (۲۰۱۶) نشان می‌دهند که نوآوری در عدم اطمینان سیاست، باعث کاهش سرمایه‌گذاری، اشتغال و تولید می‌شود. عدم اطمینان سیاسی، نوع عدم اطمینان در مورد نوع سیاست‌های دولت را از عدم اطمینان سیاست اقتصادی متمایز می‌کند که به عدم اطمینان در خصوص سیاست‌هایی که قبلاً تصویب‌شده، مربوط می‌شود. آن‌ها نشان می‌دهند که شوک‌های ناشی از عدم اطمینان سیاسی می‌تواند باعث کاهش قابل‌ملاحظه سرمایه‌گذاری‌های کلان در بخش اقتصاد شود. پس از دو جنگ جهانی اول و دوم، حمایت از حقوق بشر، موجب گسترش قواید بین المللی شد که حاوی تعهدات بالعوض در جهت منافع مشترک بشریت و طرح مسائل جدید از جمله بهره برداری از فضای ماوراء جو، میراث مشترک بشری و محیط زیست شده و اهمیت این قواعد، در نظام بین المللی افزایش چشمگیری یافت(ابوالحسنی و همکاران، ۱۳۹۶).

علاوه بر این، فرناندز ویلورده، گورون–کینتانا، روبیو–رامیرز و یوریبه[1] (۲۰۱۱) شواهد تجربی را ارائه می‌دهند که نوسانات نرخ بهره واقعی که در آن اقتصادهای کوچک(از جمله نظام جمهوری اسلامی ایران) در حال گسترش هستند، در چرخه کسب‌وکار مهم هستند. با توجه به فرآیند نوسانات تصادفی برای نرخ بهره واقعی، این فرایند را در مدل استاندارد چرخه باز اقتصاد کوچک، بازبینی می‌کند و یافته‌ها حاکی از آن است که افزایش نرخ نوسانات واقعی نرخ بهره باعث کاهش تولید و مصرف در میان متغیرها می‌شود. پژوهشی دیگر نشان می‌دهد که در نابسامانی‌های ناگهانی در عدم قطعیت، ناهمگونی زیادی وجود دارد. شواهد در اقتصادهای در حال ظهور، در مقایسه با ایالات‌متحده و سایر کشورهای توسعه‌یافته، سقوط شدید سرمایه‌گذاری و مصرف خصوصی را پس از یک شوک بی‌ثباتی خارجی نشان می‌دهند. اقتصادهای نوظهور نیز به‌طور چشمگیری در طولانی‌مدت بهبود می‌یابند که چنانچه در این فاصله شوک‌های مختلف دیگری وارد شود، کنترل شوک‌ها در اقتصاد کاری دشوار خواهد بود و کشور با فراز و نشیب‌های مختلف در بخش‌های مختلف روبرو خواهد شد.

1. Fern_andez-Villaverde, Guerron-Quintana, Rubio-Ramirez and Uribe

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

فشارهای مالی که کشورهایی با اقتصاد در حال ظهور(جمهوری اسلامی ایران) با آن مواجه هستند، ممکن است تأثیرات ناشی از شوک‌های نا اطمینانی را تشدید کند. داکلوئی و الوئی (۲۰۱۶) تعامل بین عدم قطعیت سیاست اقتصادی ایالات‌متحده و بازارهای سهام BRIC را بررسی می‌کنند. آن‌ها شواهدی برای حمایت از یک همبستگی متغیر زمانی بین عدم قطعیت اقتصادی ایالات‌متحده و بی‌ثباتی بازار سهام BRIC را مطالعه می‌کنند. آن‌ها نشان می‌دهند که همبستگی زمانی که بی‌ثباتی اقتصادی جهانی رخ می‌دهد، بیشتر بی‌ثبات است. این مقاله نیز به مطالعه این موارد می‌پردازد و تأثیر خطرات ژئوپلیتیک جهانی در سیاست‌های اقتصادی کشورهای درحال‌توسعه (جمهوری اسلامی ایران) را بررسی می‌کند. یکی از ملزومات ارزیابی رفتار صدوپانزدهمین کنگره در قبال ایران در دوران ریاست جمهوری دونالد ترامپ، بررسی سیر تطور سیاستهای تحریمی قانونگذاران آمریکا در دوران ریاست جمهوری باراک اوباما میباشد. دوره ریاست جمهوری ۸ ساله باراک اوباما با فعالیت کنگره صد و یازدهم (۲۰۰۹-۲۰۱۰) صد و دوازدهم (۲۰۱۱-۲۰۱۲) صد و سیزدهم (۲۰۱۳-۲۰۱٤) و صد و چهاردهم (۲۰۱۵-۲۰۱٦) مصادف شده بود (دلاور پوراقدم و دهقانی فیروز ابادی، ۱۳۹٦).

علاوه بر این، این پژوهش به ادبیات گسترده اقتصاد بین‌المللی مربوط است که چگونه سیاست‌های اقتصادی در کشورهای درحال‌توسعه و نوظهور تحت تأثیر شوک‌های جهانی قرار می‌گیرد. کوز (۲۰۰۲) یک مدل اقتصادی باز بازدارنده چند بخشه پویا تصحیح‌شده برای تحلیل نقش شوک‌های قیمت جهانی (تغییر قیمت سرمایه و نرخ بهره کلمات) در شروع و انتشار چرخه‌های کسب‌وکار در کشورهای کوچک و باز را توسعه داده‌اند. این پژوهش نشان می‌دهد که شوک‌های قیمت جهانی به دلیل کمبود قابل‌توجهی از متغیرهای چرخه تجاری در کشورهای درحال‌توسعه بسیار بااهمیت است. سیستمهای امنیتی منطقهای را میتوان به ً منزله الگوهای دوستی و دشمنی که عمدتا در منطقه جغرافیایی خاصی متمرکز هستند، به شمار آورد و از عبارت »مجموعه امنیتی« یا«مجتمع امنیتی«برای اشاره به آن استفاده نمود(قیاسوندی و ترکاشوند،۱۳۹٦).

نکته کلیدی این است که شوک‌های خطرناک جهانی بسیار مهم هستند و سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی کشورهای درحال‌توسعه را به چالش می‌کشند که مطالعه در این زمینه بسیار حائز اهمیت و باارزش است. این پژوهش به این مهم می‌پردازد.

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

شیمیت گرو و اوبری[1] (۲۰۱۷) استدلال می‌کنند که برخلاف دیدگاه شایع، شوک‌های تجاری، نیروی زیادی در اختلالات کل در اقتصادهای نوظهور ندارند. با استفاده از مدل‌های VAR ساختاری تجربی در ۳۸ کشور در حال ظهور، نشان می‌دهد که شوک‌های شرایط تجاری کمتر از ۱۰ درصد از تغییرات تولید را در نمونه خود توضیح می‌دهند. اما این پژوهش باور دارد که حتی با توجه به شرایط نگرشی جهانی و شرایط تجارت، خطرات ژئوپلیتیک، عامل مهمی در توضیح شوک‌های سیاسی و مدیریتی در اقتصادهای در حال ظهور و در حال توسعه از جمله کشور ما است. درنهایت، این پژوهش به بررسی نتایج اقتصاد کلان در مورد ریسک و خطرات ژئوپلیتیکی می‌پردازد. پژوهش‌های گذشته نشان می‌دهند که تروریسم تأثیر منفی بر رشد اقتصادی دارد. گلیکز و تیلور (۲۰۱۰) با بررسی تأثیر گسترده جنگ بر تجارت و رفاه اقتصادی جهانی یک مدل نظری را ارائه می‌دهند که توضیح می‌دهد چگونه فعالیت‌های تروریستی فعالیت‌های اقتصاد کلان را کاهش می‌دهد.

گلیکز و تیلور[2] (۲۰۱۰) با پژوهشی با عنوان تأثیر گسترده جنگ بر تجارت و رفاه اقتصادی جهانی، یک مدل نظری را ارائه می‌دهند که توضیح می‌دهد چگونه فعالیت‌های تروریستی فعالیت‌های اقتصاد کلان را کاهش می‌دهد و از طریق کاهش ارزش‌های آینده نسبت به حال حاضر کاهش می‌یابد. کلدارا و ایاکوویلو (۲۰۱۸) اخیراً یک شاخص خطر جغرافیایی را برای ترسیم وقایع و خطرات ژئوپلیتیک به‌عنوان ادراک و ترسیم در مطبوعات در کشورهای انگلیسی‌زبان توسعه می‌دهد. نتایج تجربی آن‌ها نشان می‌دهد که خطر ژئوپلیتیک شدید منجر به کاهش فعالیت واقعی، گسترش بیشتر اعتبارات، بازده سهام و کاهش سرمایه از اقتصادهای در حال ظهور به سمت پیشرفته‌تر می‌شود. این پژوهش برآوردهای تجربی را در مورد چگونگی تأثیر ریسک ژئوپلیتیک بر سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی نظام جمهوری اسلامی ایران با استفاده از این اقدام جدید ریسک ژئوپلیتیکی که توسط کالدارا و ایاکوویلو (۲۰۱۸) ایجاد شده است، برآورده می‌کند.

کلدارا و ایاکوویلو[3] (۲۰۱۸) اخیراً یک شاخص خطر جغرافیایی را برای ترسیم وقایع و خطرات ژئوپلیتیک به‌عنوان ادراک و ترسیم در مطبوعات در کشورهای انگلیسی‌زبان انجام

1. Schmitt-Groh_e and Uribe
2. Glick and Taylor
3. Caldara and Iacoviello

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

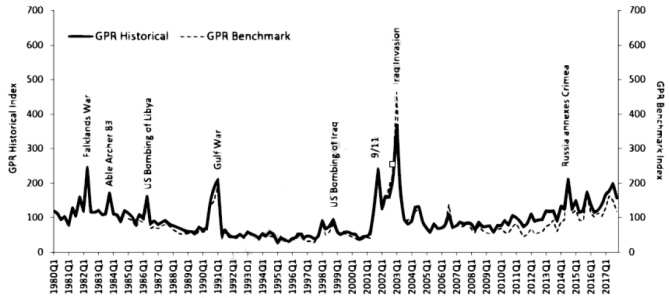
داده‌اند. نتایج تجربی آن‌ها نشان می‌دهد که خطر ژئوپلیتیک شدید منجر به کاهش فعالیت واقعی، گسترش بیشتر اعتبارات، بازده سهام و کاهش سرمایه از اقتصادهای در حال ظهور به سمت پیشرفته‌تر می‌شود.

در کل، این مقاله شواهدی را نشان می‌دهد که شوک‌های ژئوپلیتیک جهانی یک منبع قابل‌توجه از تغییرات در کشورهای در حال ظهور و درحال‌توسعه ازجمله کشور ایران است و در این پژوهش این نظام موردمطالعه قرارگرفته است.

روش‌شناسی

این پژوهش به‌صورت توصیفی پیمایشی و از نوع کاربردی و توسعه‌ای است. فلسفه پژوهش اثبات‌گرایی و شیوه گردآوری اطلاعات به‌صورت کتابخانه‌ای و میدانی است. کالدارا و لوکولیو (۲۰۱۸) دو شاخص را برای خطرات ژئوپلیتیک جهانی در نظر گرفته‌اند: شاخص ریسک ژئوپلیتیک معیار (GPRB) و شاخص خطر جغرافیایی تاریخی (GPRH). شاخص معیار در سال ۱۹۸۵ شکل‌گرفته است و شاخص تاریخی از سال ۱۹۰۰ شکل‌گرفته است. هر دو شاخص برای بررسی ریسک ژئوپلیتیک از شش شاخص استفاده می‌کنند: تهدیدات ژئوپلیتیک، تهدیدات هسته‌ای، تهدید جنگ، تهدید تروریستی، اقدامات جنگی و اقدامات تروریستی.

شکل ۱ شاخص GPR تاریخی و شاخص GPR معیار را نشان می‌دهد. همان‌طور که نشان داده‌شده است، شاخص‌های تاریخی و معیار به‌شدت به هم وابسته هستند و این همبستگی بدون قید و شرط برابر با ۰,۹۷ است. در حوادث سیاسی مانند جنگ خلیج در سال ۱۹۹۰، حمله تروریستی ۱۱ سپتامبر در سال ۲۰۰۱ و حمله به عراق در سال ۲۰۰۳ این دو شاخص به‌شدت افزایش‌یافته‌اند.



شکل (۱): شاخص‌های ریسک ژئوپلیتیک تاریخی و معیار

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

برای انجام تجزیه‌وتحلیل تجزیه واریانس برای کشور ایران (نظام جمهوری اسلامی یاران)، یک مدل VAR را از طریق روش حداقل مربعات عادی و جزئی (OLS) تخمین می‌زنیم. به‌طور خاص، ما مدل پایه زیر را در نظر می‌گیریم:

$$B(L)yt = d + \mu_t$$

جایی که y_t یک بردار از متغیرهای درونی است، d یک بردار از اصطلاحات ثابت است و μ_t جزء کمینه شکل است

$$E(\mu_t) = 0 \text{ and } E(\mu_t \mu_t') = \Sigma.\ B(L)$$

B(L) توسط داده الگوی $I+B_1L+B_2L_2 \ldots + B_NL^N$ زیر ارائه می‌شود:

جایی که N طول ضریب مدل VAR است.

متغیرهای زیر در مدل VAR شامل: شاخص خطر ژئوپلیتیک هستند.

(GPRt)، تولید ناخالص داخلی سرانه (GDPt)، سرمایه‌گذاری ناخالص واقعی سرانه است مصرف سرانه (C_t)، نرخ ارز واقعی (RER_t) و تعادل تجارت (TB_t)

بردار yt به‌این‌ترتیب به‌صورت زیر خوانده می‌شود:

$$y_t = [GPR_t, TB_t, GDP_t, C_t, I_t, RER_t]'$$

در این پژوهش به‌جای شاخص GPR تاریخی، شاخص GPR معیار در برآورد در نظر گرفته‌شده است. (شاخص GPR معیار از سال ۱۹۸۵ در دسترس است). بر این اساس، داده‌های سالانه بین سال‌های ۲۰۱۰ تا ۲۰۱۷ را به کار گرفته‌ایم. تاریخ شروع داده بر اساس در دسترس بودن شرایط تجارت داده‌ها در پایگاه داده جهانی شاخص‌های توسعه جهانی (WDI) است (شوک‌های خطر جغرافیایی یکسان بر متغیرهای دیگر تأثیر می‌گذارد).

یافته‌های پژوهش

نتایج نشان می‌دهد که افزایش غیرمنتظره درخطر جغرافیایی باعث کاهش تولید واقعی، مصرف و سرمایه‌گذاری می‌شود. به‌طور خاص، میزان پیک مصرف و سرمایه‌گذاری به ترتیب ۰.۸ و ۲.۲ درصد است. نرخ ارز واقعی با بیش از دو درصد کاهش همراه است (بهبود تعادل تجاری در حدود ۰.٤ درصد است). به‌طورکلی، خروجی متوسط تقریباً یک درصد کاهش می‌یابد. نتیجه این‌که خطر ژئوپلیتیک افزایش‌یافته منجر به کاهش واقعی نرخ ارز می‌شود، درواقع با

انجمن مطالعات جهان اسلام
Islamic World Studies Association
جمعیة دراسات العالم الاسلامی
فصلنامه علمی -پژوهشی
پژوهشهای سیاسی جهان اسلام

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

نتایج کلدارا و ایاکوویلو (۲۰۱۸) همخوانی دارد که نشان می‌دهد که کشورهای در حال ظهور پس از شوک ریسک ژئوپلیتیک شاهد سرمایه‌گذاری هستند. تعادل تجارت هنگامی‌که نرخ واقعی ارز کاهش می‌یابد، بهبود می‌یابد، اما بهبود به‌اندازه کافی بزرگ نیست که تأثیر انقباضی بر مصرف و سرمایه‌گذاری را تعیین کند.

تجزیه‌وتحلیل ما در کشور جمهوری اسلامی ایران تکمیل مطالعه کلدارا و ایاکوویلو در سال ۲۰۱۸ است که به‌جای آن بر اقتصاد کلان (سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی در کشور و نظام جمهوری اسلامی ایران) و شوک‌های جغرافیایی سیاسی تمرکز دارد. نتایج همین‌طور نشان می‌دهد که کاهش تولید ناشی از کاهش در مصرف و سرمایه‌گذاری است. در موارد دیگر، یک ضربه GPR به‌طور عمده از طریق سرمایه‌گذاری خارج می‌شود. علاوه بر این، شوک‌های GPR هیچ اثر آماری قابل‌توجهی بر کشور ندارد. در حقیقت، با اندازه‌گیری خطوط خطا حاوی صفر، تأثیر شوک GPR بر تعادل تجاری، قابل‌مقایسه نیست. تأثیرات بر روی سرمایه‌گذاری و خروجی به‌طور آماری، نامشخص است.

جدول ۱ نتایج حاصل از مدل پایه برای کشور را گزارش می‌دهد. همان‌گونه که می‌بینیم، سهم واریانس خروجی که توسط شواهد ریسک ژئوپلیتیکی توضیح داده‌شده، به‌طور گسترده‌ای در کشور متفاوت است. به‌طورکلی، یافته‌ها نشان می‌دهد که شوک‌های خطر ژئوپلیتیک، یک منبع قابل‌توجه برای سیاست‌ها و مدیریت اقتصاد در کشور است.

جدول (۱): سهم واریانس توضیح داده‌شده توسط شوک‌های خطر جهانی ژئوپلیتیک

	RER	I	C	GDP	TB	GPR
	کنترل نوسانات بازار سهام ایالات‌متحده	کنترل شاخص عدم قطعیت سیاست اقتصادی ایالات‌متحده و بخش امنیت ملی	کنترل وضعیت جهانی ناشی از گسترش اوراق قرضه شرکتی	کنترل شرایط تجارت	آرامش برفرض بیرونی بر شاخص GPR	شاخص GPR معیار
ایران	۱۶	۹	۱۳	۱۰	۷	۱۰۰

ما نتایج اولیه خود را با در نظر گرفتن انواع مدل‌های مختلف و کنترل انواع خطرات به دست می‌آوریم. به‌طور خاص، ما انواع مدل پایه ما را با استفاده از (I) با استفاده از داده‌های Hodrick{Prescott(HP)؛ (ii) استفاده از شاخص GPR معیار؛ (iii) آرامش برفرض بیرونی بر شاخص GPR؛ (iv) کنترل شرایط تجارت؛ (v) کنترل وضعیت جهانی ناشی از گسترش

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

اوراق قرضه شرکتی (Akinci 2013)؛ (vi) کنترل شاخص عدم قطعیت سیاست اقتصادی ایالات‌متحده (EPU) و بخش امنیت ملی؛ و (vii) کنترل نوسانات بازار سهام ایالات‌متحده برای کشور ایران در نظر می‌گیریم.

نتایج این پژوهش ممکن است به روش‌های متنوعی حساس باشد. برای مقابله با این مسئله، مدل ابتدایی را با استفاده از داده‌هایی که توسط Hodrick-Prescott _lter (Hodrick and Prescott, 1997) آورده شده است، برآورد می‌کنیم. شوک‌های GPR به‌طور متوسط ۱۶ درصد از محاسبات خروجی را توضیح می‌دهد.

با استفاده از شاخص GPR معیار به‌جای شاخص GPR تاریخی، مورد دیگری را بررسی می‌کنیم. ازآنجایی‌که شاخص معیار GPR از سال ۱۹۸۵ شروع می‌شود، مشاهدات مشابهی را از شاخص تاریخی GPR از ۲۰۱۰ تا ۲۰۱٤ استخراج می‌کنیم تا اطمینان حاصل شود که حداقل ۳۰ مشاهدات سالانه متوالی داشته باشیم. نتایج نشان می‌دهد که شوک‌های شاخص GPR معیار به‌طور متوسط ۱۸ درصد از تغییرات تولید در این کشور ایران را توضیح می‌دهد.

مدل ابتدایی را مجدداً با برطرف کردن فرض بیرونی با GPRT تخمین زدیم. به‌بیان‌دیگر، ما شرایط اقتصادی کشور را به وضعیت تکامل خطرات سیاسی جهانی تحمیل می‌کنیم. نتایج نشان می‌دهد که شوک‌های شاخص GPR معیار به‌طور متوسط ۱۵ درصد از نوسانات خروجی در کشوررا توضیح می‌دهند.

شرایط شوک تجاری بر روی شاخص ریسک ژئوپلیتیک تأثیر می‌گذارد، اما یک شوک ژئوپلیتیک شرایط تجارت را با یک تأخیر به نمایش می‌گذارد. ما می‌بینیم که شوک‌های GPR به‌طور متوسط ۱۹ درصد از نوسانات خروجی را توضیح می‌دهند، درحالی‌که TOT شوک‌ها ۸ درصد را توضیح می‌دهد که این نتایج با یافته‌های اسمیت، گروه و اوربی[1] در سال ۲۰۱۷ هم‌خوانی دارد.

از طرفی نتایج نشان می‌دهد که یک شوک در حال گسترش بر شاخص معیار ریسک ژئوپلیتیک تأثیر می‌گذارد، اما یک شوک GPR موجب گسترش نرخ بهره با یک تأخیر می‌شود.

ما می‌بینیم که شوک‌های GPR به‌طور متوسط ۱۵ درصد از نوسانات خروجی را توضیح

1. Schmitt-Grohe and Uribe

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

می‌دهند، درحالی‌که شوک‌های اسپرد ۱۱ درصد را توضیح می‌دهد. توجه داشته باشید که قدرت تفسیر شوک‌های اسپرد از ۲۰ درصد کاهش‌یافته است، نتایج نشان می‌دهند که نقش چالش‌های سیاسی جهانی در توضیح و تغییر سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی نظام جمهوری اسلامی ایران مؤثر است.

شوک EPU بر روی شاخص ریسک ژئوپلیتیک تأثیر می‌گذارد، اما یک ضریب GPR شاخص EPU را با تأخیر نشان می‌دهد.

شوک‌های GPR به‌طور متوسط ۱۸ درصد از نوسانات خروجی را توضیح می‌دهند، درحالی‌که شوک‌های EPU ۱۶ درصد را توضیح می‌دهند. شوک‌های GPR به‌طور متوسط ۲۱ درصد از شیب‌های خروجی را توضیح می‌دهند درحالی‌که بخش ملی EPU ۱۶ درصد را توضیح می‌دهد. به‌طورکلی، شوک‌های خطر جغرافیایی سیاسی، بخش بزرگی از تنوع تولید در کشور جمهوری اسلامی ایران را تشریح می‌کند.

نتایج همین‌طور نشان می‌دهد که GPR به‌طور متوسط ۱۳ درصد از خروجی را توضیح می‌دهد. شواهد ما نشان می‌دهد که شوک‌های GPR هنوز هم نسبتاً واریانس خروجی را به‌طور متوسط توضیح می‌دهند و سهم توضیح داده‌شده توسط شوک‌های GPR کمی بیشتر ازآنچه توسط شوک نوسانات بازار سهام مطرح‌شده است، می‌باشد.

انجمن مطالعات جهان اسلام
Islamic World Studies Association
جمعیة دراسات العالم الاسلامی
فصلنامه علمی -پژوهشی
پژوهشهای سیاسی جهان اسلام

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

نتیجه‌گیری

در این مقاله، ما به بررسی شوک‌ها و خطرات ژئوپلیتیک جهانی و نقش مهمی که در سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی در کشوری درحال‌توسعه ازجمله نظام جمهوری اسلامی ایران بازی می‌کنند، می‌پردازیم. ما VAR مدل‌های ساختاری را برای کشور تخمین زدیم. نتایج نشان‌دهنده آن است که شوک‌های جغرافیایی سیاسی، سهم غیرقابل توجهی از تنوع تولید در نظام جمهوری اسلامی ایران را توضیح می‌دهد. میانگین سهم جنبش‌های خروجی که به دلیل شوک‌های خطر جهانی ژئوپلیتیکی محسوب می‌شود بین ۱۳ تا ۲۲ درصد است. بااین‌حال، پاسخ‌های ضربه‌ای به شوک‌های ژئوپلیتیک به‌طور گسترده در نظام جمهوری اسلامی ایران متفاوت است. این مقاله پایه‌ای برای تحقیقات بیشتر در مورد چگونگی گسترش شواهد ریسک ژئوپلیتیک و تأثیر آن بر اقتصادهای نوظهور است.

نتایج اولیه نشان می‌دهد که افزایش غیرمنتظره درخطر جغرافیایی سیاسی باعث کاهش تولید واقعی، مصرف و سرمایه‌گذاری می‌شود. به‌طور خاص، میزان پیک مصرف و سرمایه‌گذاری به ترتیب ۰,۸ و ۲,۲ درصد است. نرخ ارز واقعی با بیش از دو درصد کاهش همراه است (بهبود تعادل تجاری در حدود ۰,٤ درصد است). به‌طورکلی، خروجی متوسط تقریباً یک درصد کاهش می‌یابد. نتیجه این‌که خطر ژئوپلیتیک افزایش‌یافته منجر به کاهش واقعی نرخ ارز می‌شود، درواقع با نتایج کلدارا و ایاکوویلو (۲۰۱۸) همخوانی دارد که نشان می‌دهد که کشورهای در حال ظهور پس از شوک ریسک ژئوپلیتیک شاهد سرمایه‌گذاری هستند. تعادل تجارت هنگامی‌که نرخ واقعی ارز کاهش می‌یابد، بهبود می‌یابد، اما بهبود به‌اندازه کافی بزرگ نیست که تأثیر انقباضی بر مصرف و سرمایه‌گذاری را تعیین کند.

هر پژوهشی دارای محدودیت های زمانی و مکانی است که این پژوهش نیز از این امر جدا نیست و دارای محدودیت هایی است که چون این محدودیت ها بخشی جدا نشدنی از هر پژوهش میباشند از گفتن انها پرهیز میشود و لذا به سایر پوهشگران پیشنهاد اده میشود شاخصه ها و متغیرهای مودر بررسی در این پژوهش تعمیم داده شود و پژوهش مجددا بررسی شود و شاخص ها و متغیرهایبه کار بسته شده در این پژوهش را در پژوهش های خود مقایسه کنند و این عنوان را در زمان ها و مکان های دیگر بررسی کنند و نتایج پژوهش هایبه دست امده را با نتایج این پژوهش مقایسه کنند.

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

منابع

[۱]- کشاورز شکری عباس، فهیمی زهرا. واکنش جهان غرب به تحولات ژئوپلیتیک شیعه و راهکارهای مقابله با آن. فصلنامه پژوهشهای سیاسی جهان اسلام. ۱۳۹۶ ۷ (۲) :۲۵-۱.

[۲]- حاتمی محمدرضا. گفتمان ژئوپلتیکی ترکیه در فضاهای تجزیه‌شدهٔ خاورمیانه. فصلنامه پژوهشهای سیاسی جهان اسلام. ۱۳۹۶؛ ۷ (۲) :۱۰۶-۸۱.

[۳]- ابوالحسنی اصغر، متقی سمیرا، درودیان مجید. نقش سیاست‌های کلان کشوری در توسعه زیست محیطی با تمرکز بر حقوق اقتصادی . فصلنامه پژوهشهای سیاسی جهان اسلام. ۱۳۹۶ ۷ (۱) :۴۴-۲۳.

[٤]- دلاورپور مصطفی، دهقانی فیروزآبادی سید جلال. دیپلماسی نومحافظه کاران کنگره آمریکا در قبال جمهوری اسلامی ایران (۲۰۱٦ ـ ۲۰۰۹) . فصلنامه پژوهشهای سیاسی جهان اسلام. ۱۳۹۶ ۷ (۱) :۲۲-۱.

[۵]- قیاسوندی فاطمه، ترکاشوند جلال. آمریکا، جنگ‌های نیابتی و امنیت خاورمیانه. فصلنامه پژوهشهای سیاسی جهان اسلام. ۱۳۹۶؛ ۷ (٤) :۲۰۵-۱٦۷.

[1] Akinci, O. 2013. Global _nancial conditions, country spreads and macroeconomic uctuations in emerging countries. Journal of International Economics 91, 358-371.

[2] Baker, S., Bloom, N., Davis, S. 2016. Measuring economic policy uncertainty. Quarterly Journal of Economics 131(4), 1598-1636.

[3] Bloom, N., 2009. The impact of uncertainty shocks. Econometrica 77 (3), 623{685.

[4] Caldara, D. , Cavallo, M., Iacoviello. M. 2017. Oil Price Elasticities and Oil Price Fluctuations, manuscript.

[5] Caldara, D., Iacoviello, M. 2018. Measuring Geopolitical Risk, manuscript.

[6] Carri_ere-Swallow, Y., C_espedes, L. 2013. The impact of uncertainty shocks in emerging economies. Journal of International Economics 90(2), 316-325.

[7] Dakhlaoui, I., Aloui, C. 2016. The interactive relationship between the US economic policy uncertainty and BRIC stock markets. International Economics 146, 141-157.

[8] Fern_andez-Villaverde, J., Guerron-Quintana, P., Rubio-Ramirez, J., Uribe, M. 2011. Risk Matters: The Real E_ects of Volatility Shocks. American Economic Review, 101(6), 2530-2561.

[9] Glick, R., Taylor, A. 2010. Collateral damage: Trade disruption and the economic impact of war. The Review of Economics and Statistics 92(1), 102-127.

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]

[10] Hodrick, R., Prescott, E. 1997. Postwar U.S. Business Cycles: An Empirical Investigation. Journal of Money, Credit and Banking 29, 1-16.

[11] Kose, A. 2002. Explaining business cycles in small open economies: How much do world.

[12] Schmitt-Groh_e, S., Uribe, M. 2017. How important are terms of trade shocks? Interna- tional Economic Review, forthcoming.

DOI: ۱۰.۲۱۸۵۹/priw-۰۸۰۲۰۴

به این مقاله این‌گونه ارجاع دهید:

درینی، ولی محمد؛ نامدار جویمی، احسان (۱۳۹۷)، «مطالعه خطرات ژئوپلیتیک جهانی در سیاست‌ها و مدیریت اقتصادی نظام جمهوری اسلامی ایران»، *فصلنامهٔ پژوهشهای سیاسی جهان اسلام*، س۸، ش۲، تابستان ۹۷، صص ۹۳-۸۱.

[Downloaded from priw.ir on 2026-11-13]