

330.115(043.3)

Д-45

ЎЗБЕКИСТОН РЕСПУБЛИКАСИ  
ОЛИЙ ВА ЎРТА МАХСУС ТАЪЛИМ ВАЗИРЛИГИ

ТОШКЕНТ ДАВЛАТ ИҚТИСОДИЁТ УНИВЕРСИТЕТИ

Қўлёзма ҳуқуқида  
УДК: 311:657.21.003.14

Джалилов Хуршид Абдурахимович

**Истеъмол сарфлари**  
**ва ялпи ички маҳсулот ўртасидаги боғланишнинг статистик**  
**тадқиқот усулларини такомиллаштириш (МХТ асосида)**

08.00.06. - «Эконометрика ва статистика»

**Иқтисод фанлари номзоди илмий даражасини**  
**олиш учун ёзилган диссертация**

**АВТОРЕФЕРАТИ**

Тошкент - 2004

Диссертация иши Тошкент молия институтида бажарилган

**Илмий раҳбар -** Иқтисод фанлари доктори, профессор  
Абдуллаев Ёрқин Абдуллаевич

**Расмий оппонентлар -** Иқтисод фанлари доктори, профессор  
Набиев Ҳамидулла Ғаниевич

Иқтисод фанлари номзоди, доцент  
Набиходжаев Аббас Абдупаттахович

**Етақчи ташкилот -** Ўзбекистон Республикаси  
Давлат статистика кумитаси

Диссертация ҳимояси «11» ноябрь 2004 йил соат 9<sup>00</sup> да Тошкент давлат иқтисодиёт университети қошидаги иқтисод фанлари доктори илмий даражаси олиш учун диссертациялар ҳимояси бўйича Д.067.06.01 ихтисослашган кенгаш мажлисида бўлади.

Манзил: 700063, Тошкент шаҳри, Ўзбекистон шох кўчаси, 49.

Диссертация билан Тошкент давлат иқтисодиёт университети кутубхонасида танишиш мумкин.

Автореферат 2004 йил «9» октябрь да тарқатилди.

Ихтисослашган кенгаш  
илмий котиби,  
иқтисод фанлари доктори,  
профессор



М.С.Қосимова

## 1. ДИССЕРТАЦИЯНИНГ УМУМИЙ ТАВСИФИ

**Кириш.** Мустақиллик йилларида мамлакатимизда давлат ҳаражатларини қискартириш, унинг тасарруфидаги корхоналарни хусусийлаштиришга ҳамда бюджет маблағларидан оқилона фойдаланишга катта эътибор берилмоқда. Хусусан, Президент И.А.Каримов нутқларида давлат ҳаражатлари хусусида тўхталиб, уларнинг ялпи ички маҳсулот (ЯИМ) даги мақбул нормаларини Ўзбекистон Республикаси мисолида аниқлаш муҳимлигини таъкидлаб ўтганлар<sup>1</sup>. Шундай шароитда истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишни моделлар асосида ўрганиш ва башоратлаш нафақат илмий-назарий, балки муҳим амалий аҳамиятга эга. Ушбу муаммолар ҳозиргача етарли даражада ўрганилмаган ва ҳали ҳам бу борада баҳс-мунозарали назарий муаммолар қўп.

Иқтисодий ўсишни таъминлаш ҳар бир мамлакат миллий иқтисодий тизимининг асосий мақсади бўлиб: циклик нобарқарорликни «силликлаш», хусусан, тўлиқ бандликка эришиш, ресурслардан тўлиқ ва самарали фойдаланиш, барқарорлик даражасидан истиқболда максимал иқтисодий ўсиш суръатига эришиш, пировард натижада жами истеъмол таркибини яхшилаш ҳамда ресурслар ҳажмини, хусусан, ишлаб чиқариш даражасини ва самарадорлигини ошириш тақозо қилинади.

Маълумки, иқтисодий ўсиш ЯИМ ҳажми ва унинг аҳоли жон бошига тўғри келган кўрсаткичининг маълум вақт оралиғида ўсиш суръати билан белгиланади. Агар мазкур кўрсаткичнинг ўсиши уч йил давомида муттасил кузатилса, иқтисодий ўсиш барқарор ҳисобланади. Буни, одатда, фақат биригина умумлаштирувчи кўрсаткич ёрдамигина эмас, балки статистик кўрсаткичлар тизими ёрдамида баҳолаш мақсадга мувофиқ, чунки ЯИМ ҳажми қатор омиллар таъсирида шаклланади.

Шундай шароитда макроиқтисодий ўсишнинг асосий қонуният ва тенденциялари нималардан иборатлиги, у ёки бу омилнинг таъсири қайси йўналишда ва айнан қандайлиги, дастлаб, биринчи навбатда нималарга эътибор бериш зарурлиги, қачон қайси ёндашув (модел ёки кичик назария, усул) ўринлилиги ва амалда самарали бўлиши тўлиқ ойдинлашмаган ҳолатда, уларни янада ойдинлаштириш лозимлиги, бозор иқтисодиёти шароити учун долзарб муаммоларнинг аниқроқ (эконометрик) ечимларини топиш заруриятини кун тартибига қўяди.

Амалда ишлаб чиқилган ва ишлайдиган макроэконометрик моделлар ва компьютер дастурлари бўлса, булар ёрдамида турли макроиқтисодий гипотезалар ва баъзи динамик «сценарийларни» текшириш, синаб кўриш имконияти бўлади. Бунинг, айниқса, социал-иқтисодий жараёнларни, хусусан, ЯИМ билан истеъмол сарфлари ўртасидаги боғланишларни

---

<sup>1</sup> Каримов И.А. 2002 йил биринчи ярим йиллигида Ўзбекистон иқтисодини ривожлантириш юзасидан устувор вазифалар ва топшириқларнинг бажарилиши ҳамда долзарб муаммоларнинг ҳал этилиши тўғрисидаги маъруза, “Қишлоқ ҳаёти”, 19 июл 2002 йил, 1-3 бетлар.

Ўр. анишда ва тегишли қарорларни қабул қилишда аҳамияти жуда каттадир. Чунки, бунда бевосита «натурал экспериментлар» ўтказишнинг имконияти йўқ, бунга фақат билвосита, шунга мос моделлар, алгоритмлар ва компьютер дастурларининг мавжудлиги жуда қўл келади. Бу эса иктисодий ўсишга, бинобарин, ЯИМ га таъсир қилувчи асосий омилларнинг эконометрик моделларини ишлаб чиқиш заруриятини долзарб қилиб қўяди.

Бу муаммоларни ўрганишда хориж иктисодчи олимларидан М.Ахсан, Д.А.Ашауэр, А.М.Баеми, Р.Ж.Барро, В.Берт, Д.Дессус, Ф.Диболд, С.С.Кван Энди, М.Кеане, С.М.Мехди, Е.Прасад, Б.С.Сахни, М.Т.Шреста ва Б.Эркин кабиларнинг қатор илмий ишлари бозор иктисоди шароитида ЯИМ нинг та.симланиши, истеъмол қилиш, жамғариш муаммолари ва уларни эконометрик моделлаштиришни фундаментал тадқиқ этишга бағишланган.

Мазкур масаланинг Миллий ҳисоблар тизими (МХТ) билан боғлиқ жиҳатларини тадқиқ этишда МДХ мамлакатларида В.С.Дадаян, А.С.Емельянов, Н.Е.Кобринский, Е.З.Майминас, А.Д.Смирнов, Ю.Н.Черемных каби таниқли олимлар муносиб ҳисса қўшганлар.

Ўзбекистонда Ё.А.Абдуллаев, М.Ирматов, Ҳ.Ф.Набиев, Р.Х.Пўлатова, Т.Ш.Шодиев, Ҳ.А.Шодиев ва бошқа олимларнинг қатор илмий ишлари бу муаммоларнинг тадқиқотиға, уларни эконометрик ва статистик моделлаштиришга бағишланган.

Ҳозирда бу жабҳада қўлаб назарий ва амалий тадқиқот ишлари амалга оширилмоқда. Жумладан, Иктисодиёт вазирлиги қошидаги «Самарали иктисодий сиёсат маркази»да ўтиш давридаги макроиктисодий таҳлилга катта эътибор қаратилган. Бирок Ўзбекистон Республикаси иктисодида истеъмол ҳаражатлари ва ялпи ички маҳсулот ўртасидаги боғланишни жаҳондаги ривожланган давлатларнинг макроиктисодий таҳлил қилишга ихтисослашган илмий текшириш институтларида қўлланиладиган эконометрик усуллардан фойдаланишга етарлича аҳамият берилмаган. Мамлакатимизда макроиктисодий кўрсаткичларни тадқиқ қилишда қўлланиладиган усуллар ушбу боғланишга хос бўлган хусусиятларни очиб бе, а олмайди ва ушбу усуллар асосида аниқланган натижалар ҳар доим ҳам юқори самарадорликка эга бўлавермайди. Бу эса, мазкур мавзунини чуқурроқ ўрганиш ва таклифлар ишлаб чиқишни такозо этади.

**Тадқиқот мақсади.** Илмий ишнинг асосий мақсади истеъмол ҳаражатлари ва ялпи ички маҳсулот ўртасидаги боғланишни ўрганишда хорижда қўлланиладиган замонавий эконометрик усулларни Ўзбекистон Республикаси шароитида қўллаш методологиясини ишлаб чиқишдан иборат.

#### **Тадқиқот вазифалари:**

- макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги боғлиқликни тадқиқ қилиш асосида бугунги кунда Ўзбекистонда мавжуд бўлган шу соҳадаги муаммоларни ўрганиш;

- Миллий ҳисоблар тизимида ЯИМ ва истеъмол ҳаражатлари кўрсаткичларининг шаклланиши ва уларга таъсир қилувчи омилларни таҳлил

килиш ҳамда мавжуд муаммоларни бартараф этиш бўйича таклифлар ишлаб чиқиш;

- макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги боғлиқликни уларнинг хусусиятларини инобатга олган ҳолда таҳлил қилишда бугунги кунда жаҳоннинг энг етуқ илмий текшириш институтларида кенг фойдаланиладиган Йохансен коинтеграцион таҳлил усули моҳиятини ёритиш ва шу усулда Канада, Корея Республикаси ва Ўзбекистон давлатлари кўрсаткичлари мисолида истеъмол ҳаражатлари ва ялпи ички маҳсулот ўртасидаги боғланишни ўрганиш. Ушбу давлатлар танлаб олинганлигининг асосий сабаби улар уч хил иктисод – ривожланган, ривожланаётган ва бозор иктисодига ўтиш даврини бошидан кечираётган давлатлардир;

- Канада, Корея Республикаси ва Ўзбекистон давлатлари кўрсаткичлари бўйича амалга оширилган эконометрик ва статистик таҳлил усуллари ва натижаларини истеъмол ва даромад ўртасидаги боғланишни ифодалайдиган жаҳондаги турли назариялар билан таққослаш ва хулосалар чиқариш.

Юқорида санаб ўтилган вазифаларни ўзаро боғлиқликда ҳал этиш Ўзбекистон иктисодида кўрсаткичларнинг шаклланиши ва уларнинг боғланиши билан боғлиқ қатор масалалар мажмуаси ечимини ўз ичига қамраб олади.

**Тадқиқот натижаларининг илмий янгилиги** қуйидагилардан иборат:

- Ўзбекистон МХТ да ялпи ички маҳсулот ва истеъмол ҳаражатларини ифодаловчи кўрсаткичларни аниқлашда “ҳисобга олинмаган иктисод” ни ҳам ҳисобга олиш ва юқоридаги кўрсаткичларни янада аниқроқ аниқлаш лозимлиги ҳамда унинг усуллари кўрсатилди. Шу мақсадда мамлакатимиз шароитларини эътиборга олган ҳолда тузилган ижтимоий сўровномалар орқали бевосита статистик кузатишлар ўтказиш услубияти мукамаллаштирилди;

- ЯИМ ва истеъмол ҳаражатлари орасидаги боғланишни ўрганишда Ўзбекистонда қўлланиладиган корреляцион-регрессион таҳлил усулининг ютуқ ва камчиликлари кўрсатилиб, бу мақсадда Йохансен коинтеграцион усулини қўллаш мақсадга мувофиқлиги қайд этилди ва эконометрик моделлар тизими ишлаб чиқилди;

- Канада, Корея Республикаси ва Ўзбекистон давлатларининг макроиктисодий кўрсаткичлари орасидаги боғланишлар Йохансен коинтеграцион таҳлил усулини қўллаб тадқиқ этилди, хулосалар қилинди ва бу усулни бизнинг амалиётда кенг қўллаш лозимлиги назарий ва амалий жиҳатдан исботланди;

- мамлакатимизда истеъмол самарадорлигини ошириш ва унинг иктисодий ўсишга ижобий таъсирини таъминлайдиган таклифлар ишлаб чиқилди.

**Тадқиқотнинг объекти ва предмети.** Тадқиқотнинг объекти бўлиб Ўзбекистон, Канада ва Корея Республикаси макроиктисодиёти, предмети бўлиб эса истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишнинг

статистик тадқиқот усулларини, хусусан, коинтеграцион таҳлил усулини қўллашнинг илмий-назарий ва услубий асосларини ишлаб чиқиш ва уни маъналикта амалиётда қўллашни амалга ошириш ҳисобланади.

**Тадқиқотнинг назарий-услубий асослари.** Ўзбекистон Республикасининг қонунлари, Президент фармонлари ва Вазирлар Маҳкамасининг қарорлари, Президент И.Каримовнинг макроиктисодий масалаларга бағишланган асарлари, нутқлари тадқиқотнинг назарий-услубий асосини ташкил этади.

Ўзбекистон Республикаси Иқтисодиёт вазирлиги, Молия вазирлиги, Давлат статистика қўмитаси маълумотлари ва ҳужжатлари, иқтисодчи олимларнинг монографик ишланмалари, шунингдек, илмий изланишларнинг натижалари ҳамда матбуотда эълон қилинган фактлар, муаллифнинг ўз кўралишлари ва ҳисоб-китоблари мазкур илмий тадқиқот ишининг ахборот базаси ҳисобланади.

Тадқиқотда статистиканинг тизимли-таркибий, функционал, киёсий таҳлил, график, индекс ва корреляцион-регрессион таҳлил усулларидан кенг фойдаланилди.

**Тадқиқот натижаларининг назарий ва амалий аҳамияти.** Диссертацияда истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишнинг статистик тадқиқот усуллари илк бор хорижий давлатларда амал қилаётган макроэконометрик моделларига киёсланган ҳолда таҳлил қилинган ва макроиктисодий кўрсаткичларни ўрганишда коинтеграцион таҳлил усулини қўллаш лозимлиги назарий ва амалий жиҳатдан исботланган.

Илмий ишда илгари сурилган тавсия ва таклифлар қуйидаги йўналишларда, яъни:

- иқтисодий тизимларни бошқаришда вужудга келиши мумкин бўлган муаммоларнинг асосий сабабларини аниқлашда, хусусан, даромаднинг мутаносиб равишда тақсимланишида;
- макроиктисодий кўрсаткичлар тизимидаги ўзгаришлар сабабларини очишда;
- республикада иқтисодий стратегиянинг мақбул йўналишларини танлаб олишда;
- давлат таълим стандартларига мувофиқ «Статистика», «Эконометрика», «Макроиктисодиёт» каби йўналишлар ҳамда мутахассисларга дахлдор туркум фанлар, шунингдек, махсус курслардан машғулотлар ўтказишда ўз тадбиғини топиши мумкин.

**Тадқиқот натижаларининг синов ва муҳокамадан ўтказилганлиги.** Илмий иш натижалари Ўзбекистон Республикаси Президенти ҳузуридаги «Истеъдод» жамғармаси томонидан ташкил этилган «Хорижда таълим олган ёш мутахассисларнинг I конференцияси»да (2003 й.), Ўзбекистон Миллий Университетида (2004 й.), Г.В.Плеханов номидаги Россия иқтисодиёт Академиясининг Тошкент шаҳридаги филиалида бўлиб ўтган халқаро илмий-амалий конференцияларда (2004 й.)

маъруза қилиниб, уларнинг илмий тўпламларида чоп этилган илмий тезисларида ўз аксини топган.

Бундан ташқари, диссертант томонидан ишлаб чиқилган айрим илмий таклиф ва хулосаларни ҳукумат қарорлари лойиҳаларига киритилганлиги ва амалда қабул қилинганлиги ҳамда тадқиқот давомида истеъмол сарфлари ва ялпи ички маҳсулот ўртасидаги боғланишни аниқлашда коинтеграцион усулни синовдан ўтказилганлиги Ўзбекистон Республикаси Иқтисодий вазирлигининг 2004 йил 1 июлдаги 3-0/23 сонли хати билан тасдиқланган.

**Нашр қилинган илмий ишлар.** Тадқиқотнинг асосий натижалари республикада журналларида чоп этилган 5 та илмий мақола ва битта тезисда ўз ифодасини топган бўлиб, уларнинг умумий ҳажми 2,5 босма табакни ташкил этади.

**Диссертациянинг таркиби.** Диссертация кириш қисми, учта боб, хулоса ва таклифлар, адабиётлар рўйхати ҳамда иловалардан иборат. Диссертация жами 128 компьютер ёзувидаги саҳифадан иборат бўлиб, 42 та жаҳвал ва 21 та чизмани ўз ичига олган.

**Кириш қисмида** тадқиқотнинг долзарблиги, унинг мақсад ва вазифалари, илмий янгилиги ва аҳамияти ёритилган.

**Биринчи боб** – «Макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги боғланишни статистик тадқиқот қилиш муаммолари» деб номланиб, унда макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги боғланишни тадқиқ қилишнинг Ўзбекистондаги мавжуд муаммолари ёритилган.

**Иккинчи боб** – «Истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишни тадқиқ қилишнинг илмий-услубий асослари» деб номланади. Мазкур бобда истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишни тадқиқ қилишнинг илмий-услубий асослари ишлаб чиқилган.

**Учинчи боб** – «Айрим мамлакатларда истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишни тадқиқот қилиш натижалари» деб номланиб, унда истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланиш Канада, Корея Республикаси ва Ўзбекистон Республикаси кўрсаткичлари мисолида қисқич таҳлил қилинган

**Диссертациянинг якуний қисмида** таҳлиллар натижалари асосида хулоса қилинган ва мамлакатимиз амалий эконометрика ва статистика соҳаларида бугунги кунда амалга оширилиши лозим бўлган вазифалар бўйича таклифлар берилган.

**Иловада** компьютердаги ҳисоб-китоблар алгоритми ўз аксини топган.

## 2. ДИССЕРТАЦИЯНИНГ АСОСИЙ МАЗМУНИ

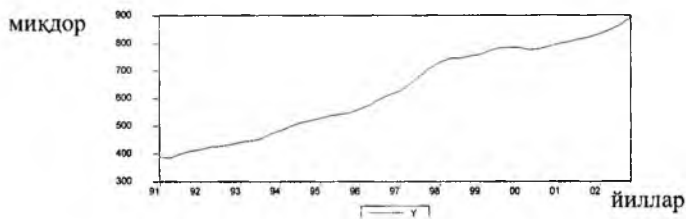
Макроиктисодий кўрсаткичлар (масалан, ялпи ички маҳсулот, ялпи миллий даромад, инфляция, ишсизлик даражаси ва ҳоказолар) нинг истиқболли ҳажм ва даражаларини аниқлашда регрессион моделлардан фойдаланиш муҳим аҳамиятга эга. Макроиктисодий ўзгаришларнинг

натижаларини таҳлил қилиш ва истикболлаш ҳар бир иктисодчи, қолаверса, мамлакат бошқаруви учун ҳам жуда муҳимдир. Маълумки, ҳозирги кунда мамлакатимизда макроиктисодий кўрсаткичларнинг бир-бирига ўзаро таъсирини аниқлашда, уларнинг истикболдаги тизимини таҳлил қилишда турли хил усуллар уларга хос бўлган хусусиятларни инобатга олмаган ҳолда қўлланиб келинмоқда. Тадқиқот натижалари кўп ҳолларда макроиктисодий кўрсаткичларнинг қисқа ва узок муддатдаги ўзаро боғлиқлик даражалари, уларнинг келажақдаги тизими, қолаверса, мамлакатда амалга оширилаётган ислохотлар оқибатида кўрсаткичларнинг мувозанатдан чиқиб кетиши ва маълум бир даврдан сўнг уларнинг яна барқарор ҳолатга қайтиши ҳақида тўлароқ маълумот бермаяпти. Ваҳоланки, мувозанатдан чиқиб кетган макроиктисодий кўрсаткичларнинг яна барқарор ҳолатга қайтиши жуда муҳимдир. Чунки иктисодий шок (иктисодда содир бўладиган турли хил ўзгаришлар)дан кейин улар мувозанат ҳолатига қайтиб келмаса, кўрсаткичларнинг келажақдаги тизими истикболини аниқлаб бўлмайди. Шунинг учун макроиктисодий кўрсаткичларни таҳлил қилишда уларнинг хусусиятларини ҳам инобатга олган ҳолда ўрганиш бугунги кунда Ўзбекистонда энг долзарб масалалардан ҳисобланади. Шу ўринда уларнинг хусусиятларини ёритиш жуда ўринлидир.

Макроиктисодий кўрсаткичлар, асосан, тренд, мавсумийлик, даврийлик ва тасодифийлик каби хусусиятларга эга бўлади. Ўз навбатида тренд икки хил бўлиши мумкин: алгебраик формулалар орқали акс этириладиган тренд ҳамда стохастик тренд. Стохастик тренд бу тизими ҳеч қандай алгебраик формулалар орқали ифодалаб бўлмайдиган тренд ҳисобланади.

Стохастик трендга эга бўлган кўрсаткичлар табиатан ностационар бўлади ва қуйидаги кўринишга эга бўлади (1-чизма):

1-чизма. Стохастик тренд.

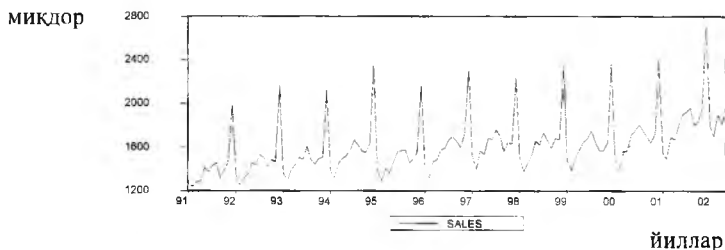


Макроиктисодий кўрсаткичларнинг аксарияти ностационар бўлганлиги сабабли 1-чизмадаги стохастик тренднинг келажақдаги тизимини унинг мазкур шаклида истикболлаш мушкулдир. Чунки бу ҳолатда кўрсаткичлар иктисодий шок сабабли мувозанатдан чиқиб кетиб, ҳеч қачон барқарор ҳолатга қайтиб келмайди.

Макроиктисодий кўрсаткичлар мавсумийлик хусусиятига эга бўлишини қуйидаги 2-чизмада кўриш мумкин.

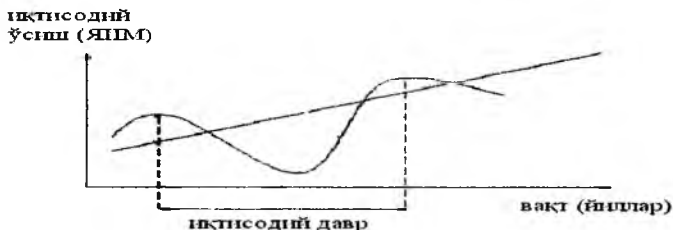


2-чизма. Мавсумий ўзгаришга эга кўрсаткич.



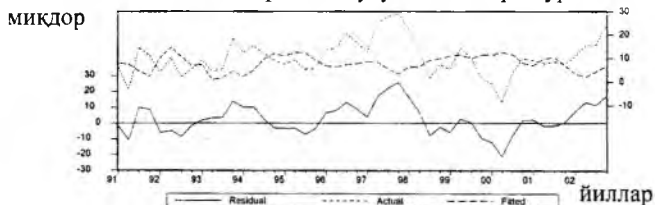
Бундай ҳолларда йилнинг маълум бир мавсумида кўрсаткич қийматлари кескин ошиб ёки камайиб кетади. Маълумки, макроиктисод ўзгаришларга ниҳоятда бой. Амалга ошириладиган туб ислохотлар натижасида маълум бир даврда (масалан, 5-10 йил мобайнида) иктисодиёт кескин ўсиши ёки пасайиши мумкин. Бу амалий эконометрикада кўрсаткичларнинг даврий хусусияти деб эътироф этилади (3-чизма).

3-чизма. Даврий хусусиятга эга кўрсаткич.



Макроиктисодий кўрсаткичларнинг яна бир хусусияти тасодифийликдир. Бундай хусусият кучли бўлган кўрсаткичларни истиқболлаш деярли мумкин эмас. Мисол тариқасида қимматли қоғозлар бозорида шаклланадиган нархларни келтириш мумкин. Уларнинг келажакдаги тизимини истиқболлаб бўлмайди (4-чизма).

4-чизма. Тасодифийлик хусусияти юқори кўрсаткич.



Акция курси айнан шундай хусусият кучли ҳисобланган кўрсаткичлар туркумига киради.

Ҳар хил макроиктисодий кўрсаткичларда юқоридаги хусусиятларнинг кучлилик даражаси турлича бўлади Шунинг учун уларнинг ҳар бирини таҳлил қилганда ўзгача ёндашув талаб этилади.

Ўзбекистонда макроиктисодий кўрсаткичларни таҳлил қилиш жғраёнида уларнинг юқоридаги хусусиятлари эътиборга олинмаган ҳолда ҳодисалар ўртасидаги боғлиқликни аниқлашда кўпинча корреляцион таҳлил усулидан кенг фойдаланилади.

Ялпи ички маҳсулот ва истеъмол сарфларини Миллий ҳисоблар тизимида ҳисоблашда ноаниқликка йўл қўйилади. Чунки иктисодда яширин, ноқонуний ва норасмий фаолият турлари мавжудки, улар ҳар доим ҳам ялпи ички маҳсулот, уй хўжаликлари истеъмол харажатлари, қолаверса, бошқа муҳим макроиктисодий кўрсаткичларда тўлиқлигича ифодаланмай қолади. Ушбу «ҳисобга олинмаган иктисод»сиз шаклланган кўрсаткичлар тизимини таҳлил қилганда улар аниқ ва самарали натижа бермайди. “Ҳисобга олинмаган иктисод”нинг асосий манбаи уй хўжаликлари бўлганлиги сабабли, уларни мамлакатимиз статистика идоралари масъул мутахассислари томонидан ижтимоий сўров қилиш кенг йўлга қўйилган. Бу беш босқичдан иборат бўлиб, дастлаб республика бўйича жами 10000 та турли тоифадаги уй хўжаликлари танлаб олинади ва улардан ҳар ойда Microsoft Access дастури орқали тасодифий танланган 833 таси (йил давомида жами 10000 таси) ижтимоий сўровлар ёрдамида тадқиқ қилинади.

Танловдан кейинги босқичда сўров ўтказувчи статистика бошқармаси мутахассиси (интервьюер) тасодифий танланган уй хўжалиги билан тадқиқотда қатнашиш бўйича битим тузади ва “Алоқа ўрнатиш”, “Кунлик ҳаёт ажатларни ҳисобга олиш”, “Индивидуал”, “Соғлиқ бўйича” ҳамда “Яқунловчи” интервьюларни амалга оширади.

Аммо амалдаги интервью саволномаларида ноқонуний фаолиятни тадқиқ қилишга қаратилган саволлар мавжуд эмас. Шунинг учун диссертацияда ижтимоий сўровномалар бўйича Ўзбекистонда мавжуд айрим муаммоларни таҳлил қилиб, уларни бартараф этиш бўйича таклифлар берилган.

Ҳозирги кунда хориж мамлакатларининг амалий эконометрикасида макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги боғлиқликни аниқлаш ва шу асосда уларнинг истикболини аниқлаш учун Йохансен методологияси кенг қўлланилмоқда, чунки ушбу усул икки ва ундан ортиқ макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги боғланишни аниқлашда уларнинг хусусиятларини ҳам инобатга олади. Унинг фандаги янгилигини ва бошқа усулларга нисбатан самарали эканлигини эътиборга олган ҳолда мазкур илмий ишда айнан шу усулнинг моҳиятини аниқланди ҳамда уни Ўзбекистон ЯИМ ва истеъмол сарфлари орасидаги боғланишни ўрганишда қўлланди.

Йохансен коинтеграцион таҳлил усулининг моҳияти шундаки, бу усул икки ва ундан ортиқ макроиктисодий кўрсаткичлар ўртасидаги (узоқ ва яқин

муддатлардаги) боғланишни аниқлаш ҳамда иктисодда содир бўлган ўзгаришлар натижасида мувозанатдан чиқиб кетган макроиктисодий кўрсаткичларнинг яна барқарор ҳолатга қайтиб келишини ўрганиш усулидир.

Шундан келиб чиққан ҳолда эконометрик тахлилнинг қуйидаги босқичларини таклиф қиламиз:

1. Тадқиқот соҳасига оид умумиктисодий категориялар таҳлил қилинади;

2. Регрессион моделлаштириш учун асос қилиб олинadиган статистик кўрсаткичлар танлаб олинади;

3. Эконометрик модел тузилади ва унда қатнашадиган кўрсаткичлар бўйича маълумот тўпланади;

4. Энг кичик квадрат усули билан кўрсаткичлар коэффициенти аниқланади;

5. Моделнинг диагностик муаммолардан ҳолислиги текширилади;

6. Натижалар назарий жиҳатдан таҳлил қилинади ва хулосалар чиқарилади;

7. Юқоридаги шартларни қаноатлантирган модел асосида натижавий белгининг келажакдаги истиқболли қиймати аниқланади;

8. 6-босқичдаги натижаларга асосланиб, иктисодий сиёсат белгилаб олинади.

Юқорида келтирилган 3-босқич ҳам бир қанча кичик босқичларга бўлинади:

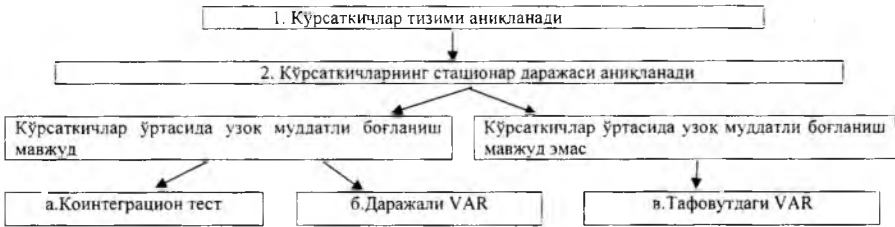
1. Кўрсаткичлар тизими аниқланади. Улар бир-бири билан боғланган ва яхлит бўлиши керак;

2. Кўрсаткичларнинг стационар даражалари бир хил бўлиши лозим. Буни текшириш учун ўтказиладиган тест – Юнит Рут тести деб номланади. Ушбу тестнинг ҳар бир кўрсаткич бўйича ўтказилган натижалари Мак Кинноннинг 1%, 5% ва 10% даги махсус критик нуқталари билан таққосланади.

Агар юқоридаги шартлар қаноатлантирилса, тестнинг кейинги босқичига ўтилади. Унда коинтеграцион тест амалга оширилади. Агар моделда қатнашаётган кўрсаткичларнинг узоқ ва яқин муддатдаги боғланишларини кўрсатувчи коэффициентлар статистик моҳиятли бўлса, регрессион моделлаштиришнинг бошқа босқичларига ўтилмайди ва тафовутдаги VAR (вектор авторегрессион модел) амалга оширилади.

Даражадаги VAR да кўрсаткичлар 1-даражали ҳолатда қатнашади (яъни  $X$ ,  $Y$  ҳолатда). Тафовутдаги VAR да кўрсаткичлар тафовутланган кўринишда ифодаланади, яъни  $DY$  ( $DY=Y-Y(-1)$ ) ва  $DX$  ( $DX=X-X(-1)$ ) кўринишда бўлади. Коинтеграцион тестнинг коэффициентлари (узоқ ва яқин муддатдаги боғланишни кўрсатувчилари) статистик моҳиятли бўлган ҳолатда даражадаги VAR ни ҳам амалга ошириш мумкин. У соддарок ҳисобланиб, кўрсаткичлар ўртасидаги фақатгина узоқ муддатдаги боғланишни ифодалайди. 5-чизмада кўрсаткичлар ўртасидаги боғлиқликни тадқиқ қилиш босқичларини келтираемиз.

## 5-чизма. Моделлаштириш босқичлари.



Фараз қилайлик, мақсадимиз икки шартли равишда белгилаб олинган ҳар қандай иктисодий кўрсаткич –  $Y$  ва  $I$  ўртасидаги узок ва яқин боғланишни аниқлаш бўлсин. Ушбу ҳолатда коинтеграцион тестнинг регрессион модели қуйидаги кўринишда ифодаланади.

$$\Delta Y_t = \gamma_{11} \Delta Y_{t-1} + \gamma_{12} \Delta I_{t-1} + \alpha_{11} (\beta_{11} Y_{t-1} + \beta_{21} I_{t-1}) + \alpha_{12} (\beta_{12} Y_{t-1} + \beta_{22} I_{t-1}) + \varepsilon_{1t} \quad (1)$$

$$\Delta I_t = \gamma_{21} \Delta Y_{t-1} + \gamma_{22} \Delta I_{t-1} + \alpha_{21} (\beta_{11} Y_{t-1} + \beta_{21} I_{t-1}) + \alpha_{22} (\beta_{12} Y_{t-1} + \beta_{22} I_{t-1}) + \varepsilon_{2t} \quad (2)$$

Бунда:  $\Delta Y = DY = Y - Y(-1)$ ,  $\Delta I = DI = I - I(-1)$ ,  $\gamma_{11}$  -  $DY$  ва унинг бир давр аввалги қиймати орасидаги эгилувчанлик (эластиклик),  $\gamma_{12}$  ва  $\gamma_{21}$  -  $DY$  ва  $DI$  ларнинг  $DI$ ,  $DY$  лар бир давр аввалги қийматлари орасидаги эгилувчанлик,  $\gamma_{22}$  -  $DI$  ва унинг бир давр аввалги қиймати орасидаги эгилувчанлик,  $\alpha_{11}$  ва  $\alpha_{12}$  -  $Y$  нинг шокка муносабати,  $\alpha_{21}$  ва  $\alpha_{22}$  -  $DI$  нинг шокка муносабати,  $\beta_{11}$ ,  $\beta_{12}$ ,  $\beta_{21}$ ,  $\beta_{22}$  -  $Y$  ва  $I$  орасидаги узок муддатдаги боғланишни кўрсатади.

Икки кўрсаткичнинг шок содир бўлган аниқ вақт (чорак, йил)да бири-бирига ўзаро таъсирини ҳам коинтеграцион таҳлил усули асосида аниқлаш мумкин.

Қуйидаги регрессион тенгламалар берилган бўлсин:

$$\Delta Y_t = \dots + a \Delta I_t + \varepsilon_{1t} \quad (3)$$

$$\Delta I_t = \dots + b \Delta Y_t + \varepsilon_{2t} \quad (4)$$

(3) регрессион тенгламада  $I_t$  даги 1% ижобий ўсишнинг шок содир бўлган вақт (чорак, йил)да  $I_t$  нинг ўзига таъсири  $1/(1-ab)$  га,  $Y_t$  га таъсири эса  $a/(1-ab)$  га тенг бўлади. Худди шундай, (4) регрессион тенгламада,  $Y_t$  даги 1% ижобий ўсишнинг шок содир бўлган вақт (чорак, йил)да  $Y_t$  унинг ўзига таъсири  $1/(1-ab)$  га,  $I_t$  га таъсири эса  $b/(1-ab)$  га тенг бўлади.

Регрессион таҳлил натижаларига кўра кўрсаткичлар кучли ва кучсиз омил бўлиши мумкин. Ихтиёрий (5) кўринишдаги регрессион моделда  $\Delta Y_t$  шокка таъсирчан бўлиб (яъни  $\alpha_{11}$  ёки  $\alpha_{12}$  статистик моҳиятли бўлса), регрессион моделда қатнашаётган бошқа кўрсаткич  $\Delta I_t$  нинг барча қийматлари статистик моҳиятли бўлмаса, унда  $\Delta Y_t$  кучли омил ҳисобланади. (5) кўринишдаги регрессион моделда  $\Delta Y_t$  шокка таъсирчан бўлиб, регрессион моделда қатнашаётган бошқа кўрсаткич  $\Delta I_t$  нинг барча ёки айрим қийматлари статистик моҳиятли бўлса, унда  $\Delta Y_t$  кучсиз омил ҳисобланади.

$$\Delta Y_t = \gamma_{11} \Delta Y_{t-1} + \gamma_{12} \Delta I_{t-1} + \alpha_{11} (\beta_{11} Y_{t-1} + \beta_{21} I_{t-1}) + \alpha_{12} (\beta_{12} Y_{t-1} + \beta_{22} I_{t-1}) + \varepsilon_{1t} \quad (5)$$

Регрессион моделлар (коинтеграцион, VAR) нинг барча боскичлари амалга оширилгандан сўнг улар диагностик тестлар бўйича синовдан ўтказилади. Унда кўрсаткичларнинг параметр бўйича барқарорлик, спецификация хатолик, хетероскедастика, автокорреляция ҳамда мультиколлениар муаммолардан ҳолислиги аниқланади.

Юқорида таҳлил қилинган Йохансен коинтеграцион тести орқали Канада давлати мисолида уй хўжаликлари истеъмол харажатлари ва иқтисодий ўсиш кўрсаткичлари ўртасидаги яқин ва узок муддатдаги боғланиш тадқиқ қилинди. Унда бирининг ошиши иккинчисининг ҳам кўпайишига олиб келиши, яъни кўрсаткичлар ўзаро мусбат боғланганлиги аниқланди (1-жадвал).

1-жадвал. Уй хўжаликлари истеъмол харажати ва ЯИМ (Канада мисолида).

DY учун			DH учун		
кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси	кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси
C	-0.032532	-3.379472	C	0.025024	3.735605
D(Y(-1))	0.356608	2.968975	D(Y)	0.510576	11.60164
D(H)	1.478929	11.98067	D(Y(-1))	-0.198805	-2.765018
D(H(-1))	-0.389485	-2.263594	D(Y(-2))	0.023495	0.398076
U(-1)	-0.426351	-4.401757	D(H(-1))	0.322056	3.183211
-	-	-	V(-1)	-0.299942	-4.224453
R <sup>2</sup> =0.85		DW=1.92	R <sup>2</sup> =0.92		DW=1.98

\*Бунда: Y–ЯИМ, H–уй хўжаликлари истеъмол харажати, V(-1)= $\beta_1 Y_{t-1} + \beta_2 H_{t-1}$ .

\*\*Халқаро валюта фонди маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

(3) ва (4) формулалар орқали 1- ва 2-жадваллардаги натижалар таҳлил қилинди. Натижалар ялпи ички маҳсулотда 1% миқдорида мусбат шокнинг бўлиши, у содир бўлган чоракнинг ўзида уй хўжаликлари истеъмол харажатлари 2,13% ва ялпи ички маҳсулотнинг ўзи эса 4,17% га ошиши, 1% мусбат шокнинг уй хўжаликлари истеъмол харажатларида содир бўлиши, ўша чоракнинг ўзида ялпи ички маҳсулот 6,17% ва уй хўжаликлари истеъмол харажатларининг 4,17% га кўпайишини ифodalади (ЯИМ ва уй хўжаликлари истеъмол харажатлари моделида). 1% мусбат шокнинг давлат истеъмол харажатларида содир бўлиши эса, шу чоракнинг ўзида давлат истеъмол харажатларининг 1.14% ва ялпи ички маҳсулотнинг 0.44% га ошишини ҳамда 1% мусбат шокнинг ЯИМ да содир бўлиши, ўша чоракнинг ўзида ялпи ички маҳсулот 1,14% ва давлат истеъмол харажатларининг 0,39% га кўпайишини кўрсатди (ЯИМ ва давлат истеъмол харажатлари моделида).

Демак, Канада давлатининг уй хўжаликлари истеъмол харажатлари ва давлат истеъмол харажатлари кўрсаткичлари иқтисодий ўсишга ижобий таъсир килар экан. Аммо уй хўжаликлари истеъмол харажатларининг иқтисодий ўсишга таъсири давлат истеъмол харажатлариникидан кучлироқ. Шунинг учун Канадада давлат харажатларини нисбатан қисқартириб, уй хўжаликларига эътиборни янада кучайтириш мақсадга мувофиқдир.

2-жадвал. Давлат истеъмол ҳаражати ва ЯИМ (Канада мисолида).

DY учун			DG учун		
кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси	кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси
C	0.04076	4.6110	D(G(-1))	0.402796	4.351
D(Y(-1))	0.368375	2.904994	D(G(-2))	-0.309949	-3.083399
D(G)	0.385332	5.270365	D(G(-3))	0.087725	1.141373
D(G(-1))	-0.153343	-1.862854	D(Y)	0.335983	2.465
D(G(-2))	-0.120485	-1.782959	D(Y(-1))	0.352853	-2.035
I(-1)	-0.223708	-4.144592	D(Y(-2))	0.188291	1.1982
R <sup>2</sup> =0.64		DW=2.04	R <sup>2</sup> =0.71		DW=2.07

\*Бунда: Y–ЯИМ, G–давлат истеъмол ҳаражатлари, I(-1)=J(-1)= $\beta_{11}Y_{t-1}+\beta_{21}G_{t-1}$ .

\*\*Халқаро валюта фонди маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

Иқтисодда шок содир бўлганда юқоридаги икки кўрсаткич мувозанатдан йироқлашади ва уларнинг иккаласи ҳам бир-бирини мувозанатга қайтаради (ЯИМ ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатлари моделида). Демак, ушбу ҳолатда уларнинг иккиси ҳам кучсиз омил ҳисобланади ((5) формулага қаранг).

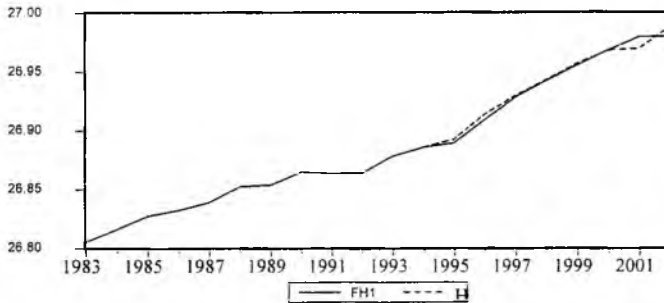
Натижалар таъкидламоқдаки, агар шок уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатларида содир бўлса, кўрсаткичлар мувозанатга қайтишининг 30.0% шок содир бўлган давр (чорак, йил) да рўй беради. Агар шок ялпи ички маҳсулотда содир бўлса, кўрсаткичлар мувозанатга қайтишининг 42,6% шок содир бўлган давр (чорак, йил) да рўй беради (ЯИМ ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатлари моделида). Шок давлат истеъмол ҳаражатларида содир бўлса, кўрсаткичлар мувозанатга қайтишининг 22.4% шок содир бўлган давр (чорак, йил) да рўй беради (ЯИМ ва давлат истеъмол ҳаражатлари моделида).

“Бир қадам олға” деб номланадиган истиқболлаш усули орқали Канада бўйича натижаларимизнинг аниқлигини таҳлил қиламиз.

Кўрсаткичлар 1948-2002 йиллардаги 55 йиллик маълумотларни ўз ичига олди. Ушбу даврни ихтиёрий равишда иккига бўламиз, яъни 1983 йилдан 1994 йилгача ва 1994 йилдан 2002 йилгача. Биринчи давр маълумотларини 1994 йилдан 2002 йилгача кўрсаткичлар истиқболли қийматини бирма-бир аниқлаймиз ва уларни 1994-2002 йиллардаги ҳақиқий қийматлар билан солиштирамиз. Агар улар орасидаги тафовут жуда кичик бўлса, демак регрессион таҳлилимиз тўғрилигига яна бир бор ишонч ҳосил қилишимиз мумкин бўлади.

Қуйидаги 6-чизмада Н-уй хўжалиги истеъмол ҳаражатларининг ҳақиқий қиймати, ГН1-уй хўжалиги истеъмол ҳаражатларининг истиқболли қиймати. Чизмада кўриниб турибдики, улар ўртасидаги тафовут жуда ҳам кичик, бу ре: рессион таҳлилимизнинг аниқлигини ва коинтеграцион тест методологиясининг самарали эканлигини яна бир бор таъкидламоқда.

6-чизма. Уй хўжалиги истеъмоли харажати истикболи (Канада мисолида)



Корея Республикасининг ЯИМ ва хусусий истеъмоли харажатлари кўрсаткичлари ўртасидаги яқин ва узок муддатдаги боғланиш Йохансен коинтеграцион тести орқали текширилиб, улар бир-бирига ижобий таъсир қилиши аниқланди (3-жадвал). Шунинг таъкидлаш жойизки, Корея Республикасида уй хўжаликлари истеъмоли харажатлари МХТ да хусусий истеъмоли харажатлари деб юритилади.

3-жадвал. Хусусий истеъмоли харажати ва ЯИМ (Корея Республикаси мисолида).

DY учун			DH учун		
кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси	кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси
C	-0.292058	-2.793931	C	0.029815	2.053055
D(Y(-5))	0.143206	2.534507	D(Y)	0.846326	12.67518
D(Y(-9))	0.082825	1.771816	D(Y(-6))	0.128563	1.787620
D(H)	0.848712	10.51593	D(H(-1))	0.340974	4.421198
D(H(-1))	-0.224883	-2.695877	D(H(-2))	-0.254411	-3.549013
D(H(-2))	0.153891	1.987937	D(H(-5))	-0.180830	-2.583336
U(-1)	-0.009808	-2.484252	D(H(-8))	-0.086566	-1.837580
R <sup>2</sup> =0.923218		DW=1.87	R <sup>2</sup> =0.914		DW=1.828

\*Бунда: Y—ЯИМ, H—хусусий истеъмоли харажати, U(-1)=V(-1)= $\beta_{11}Y_{t-1}+\beta_{21}H_{t-1}$ .

\*\*Халқаро валюта фонди маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

(3) ва (4) формулалар орқали 3- ва 4-жадваллардаги натижалар таҳлил қилинди. ЯИМда 1% мусбат шокнинг содир бўлиши, шу давр (чорак, йил) нинг ўзида ялпи ички маҳсулот 3,57% ва хусусий истеъмоли харажатлари эса 3,04% га ошиши, агар 1% мусбат шок хусусий истеъмоли харажатларида содир бўлса, ўша давр (чорак, йил) нинг ўзида хусусий истеъмоли харажатлари 3,57% ва ялпи ички маҳсулот 3,04% га кўпайиши аниқланди (ЯИМ ва хусусий истеъмоли харажатлари моделида). Шунингдек, натижалар 1% мусбат шокнинг давлат истеъмоли харажатларида содир бўлиши, шу давр (чорак, йил) нинг ўзида давлат истеъмоли харажатлари 1.15% ва ЯИМ 0.45% га ошиши, ялпи ички маҳсулотнинг 1% га кўпайиши эса, шу давр (чорак, йил) нинг ўзида ЯИМ 1.15%, давлат истеъмоли харажатларининг 0.44% га

ошишига сабаб бўлишини кўрсатди (ЯИМ ва давлат истеъмол харажатлари моделида).

Демак, уй хўжаликлари истеъмол харажатлари ва давлат истеъмол харажатлари иқтисодий ўсишга ижобий таъсир қилади. Бироқ уй хўжалиklarининг иқтисодий ўсишга таъсири юқорироқ экан. Шунинг учун уй хўжалиklarига эътиборнинг янада кучайтирилиши натижасида Корея Республикасида бундан ҳам юқорироқ иқтисодий ўсишга эришилишини таъминлаш мумкин.

4-жадвал. Давлат истеъмол харажати ва ЯИМ (Корея Республикаси мисолида).

DY учун			DG учун		
кўрсаткич	коэффицицент	t-статистикаси	кўрсаткич	коэффицицент	t-статистикаси
C	0.043152	1.798094	D(G(-1))	0.325516	2.689413
D(Y(-1))	0.405698	3.019846	D(Y)	0.345601	2.435724
D(G)	0.355359	2.818728	D(Y(-1))	0.283523	1.932922
R <sup>2</sup> =0.87		DW=1.85	R <sup>2</sup> =0.85		DW=2.05

\*Бунда: Y-ЯИМ, G-давлат истеъмол харажати, X(-1)=Z(-1)= $\beta_{11}Y_{t-1}+\beta_{21}G_{t-1}$ .

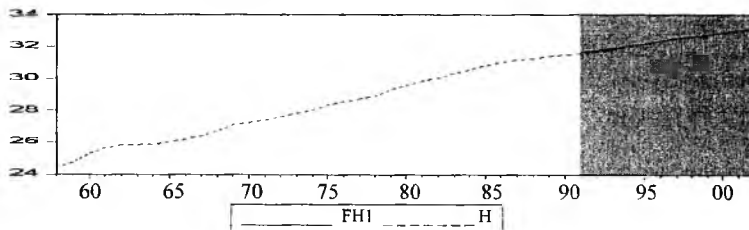
\*\*Халқаро валюта фонди маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

Иқтисодда шок натижасида икки кўрсаткич мувозанатдан йироқлашса, улардан фақат ЯИМ шокка жавоб беради. Демак, бу ҳолатда ЯИМ кучсиз омил ҳисобланади. Агар шок содир бўлса, кўрсаткичлар мувозанатга қайтишининг 0,9% шок бўлган давр (чорак, йил) нинг ўзида рўй беради (хусусий истеъмол харажатлари ва ЯИМ моделида).

Кўрсаткичлар 1953-2002 йиллардаги 50 йиллик маълумотларни ўз ичига олади. Ушбу даврни ихтиёрий равишда иккига бўламиз, яъни 1958-1991 ва 1991-2002 йиллар. Биринчи давр маълумотларини 1991 йилдан 2002 йилгача кўрсаткичлар истикболли қийматини бирма-бир аниқлаймиз ва уларни 1991-2002 йиллардаги ҳақиқий қийматлари билан солиштирамиз. Агар улар орасидаги тафовут жуда кичик бўлса, демак регрессион таҳлилимиз тўғрилигига яна бир бор ишонч ҳосил қилишимиз мумкин бўлади.

Қуйидаги 7-чизмада Н-уй хўжалиги истеъмол харажатларининг ҳақиқий қиймати, FHI-уй хўжалиги истеъмол харажатларининг истикболли қиймати. Чизмадан кўриниб турибдики, улар ўртасидаги тафовут жуда ҳам кичик, бу регрессион таҳлилимининг аниқлиги ва коинтеграцион тест методологиясининг самарали эканлигини яна бир таъкидламоқда.

7-чизма. Хусусий истеъмол харажати истикболи (Корея Республикаси мисолида).





Ўзбекистон ЯИМ ва уй хўжалиги истеъмол харажатлари кўрсаткичлари бўйича натижалар улар ўртасида коинтеграцион боғланиш мавжуд эканлигини кўрсатмоқда (5-жадвал).

5-жадвал. Уй хўжаликлари истеъмол харажати ва ЯИМ (Ўзбекистон мисолида).

DY учун			DH учун		
кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси	кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси
D(Y(-1))	-0.397627	-3.472911	C	0.526064	3.740166
D(Y(-2))	-0.606325	-4.700454	DY	0.829154	11.33159
D(H)	0.939699	15.96957	D(Y(-1))	0.553919	4.605696
D(H(-1))	0.584889	4.176860	D(Y(-2))	0.434424	2.999599
D(H(-2))	0.524868	3.436498	D(H(-1))	-0.809095	-5.216236
U(-1)	-0.163672	-2.567325	D(H(-2))	-0.514451	-3.226403
-	-	-	V(-1)	-0.045040	-3.514186
R <sup>2</sup> =0.962376		DW=2.581603	R <sup>2</sup> =0.949432		DW=2.252528

\*Бунда: Y—ЯИМ, H—уй хўжаликлари истеъмол харажати.

\*\*Ўзбекистон Республикаси Иқтисодиёт вазирлиги маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

ЯИМ ва давлат истеъмол харажатлари кўрсаткичлари бўйича таҳлилимиз улар ўртасида коинтеграцион боғланиш мавжудлигини кўрсатмоқда (6-жадвал).

6-жадвал. Давлат истеъмол харажати ва ЯИМ (Ўзбекистон мисолида).

DY учун			DG учун		
кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси	кўрсаткич	коэффициент	t-статистикаси
C	1.216352	9.722098	C	-1.343308	-5.951756
DY(-1)	0.207862	2.761546	DY	1.166623	10.81894
DG	0.682301	10.81894	DY(-1)	-0.376021	-4.360369
I(-1)	-0.939829	-10.09412	J(-1)	-1.156650	-6.486859
R <sup>2</sup> =0.889507		DW=1.850295	R <sup>2</sup> =0.858766		DW=2.082717

\*Бунда: Y—ЯИМ, G—давлат истеъмол харажатлари, I(-1)=J(-1)= $\beta_{11}Y_{t-1} + \beta_{21}G_{t-1}$ .

\*\*Ўзбекистон Республикаси Иқтисодиёт вазирлиги маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

(3) ва (4) формулалар орқали 5- ва 6-жадваллардаги натижалар таҳлил қилинганда уй хўжаликлари истеъмол харажатларида 1% ижобий ўзгариш содир бўлиши, шу чоракнинг ўзида у 4,53% га ижобий ўзгариши, бу эса иқтисодий ўсишнинг 4,26% га кўпайишига сабаб бўлиши аниқланди. Бу уй хўжаликлари истеъмол харажатларининг кўшимча мусбат кўпайиши иқтисодий ўсишга ижобий таъсир қилишини билдиради. Агар ЯИМ да 1% ижобий ўзгариш содир бўлса, шу чоракнинг ўзида у 4,53% га, уй хўжаликлари истеъмол харажати эса 3,76% га ошади. Агар иқтисодий шок бўлганда ЯИМ ва уй хўжаликлари истеъмол харажатлари кўрсаткичлари унга жавоб беради. Агар шок иқтисодий ўсишда рўй берса, мувозанатдан чиқиб кетган кўрсаткичларнинг яна барқарор ҳолатга қайтишининг 16,37% шок содир бўлган чоракда рўй беради. Иқтисодий ўзгариш уй хўжаликлари

истеъмол ҳаражатларида рўй берса, кўрсаткичлар барқарор ҳолатга кайтишининг 4,5% ўзгариш содир бўлган чоракда амалга ошади.

Шунингдек, агар давлат истеъмол ҳаражатларида 1% ўзгариш содир бўлса, шу чоракнинг ўзида у 4,9% га ўзгаради, бу эса иктисодий ўсишга 3,34% таъсир килар экан. Булар давлат истеъмол ҳаражатларининг қўшимча мусбат кўпайиши иктисодий ўсишга ижобий таъсир қилишини билдиради. ЯИМ да 1% ўзгариш содир бўлса, давлат истеъмол ҳаражатлари 5,72% га ошади. Агар иктисодий шок бўлганда, унга фақат ялпи ички маҳсулот кўрсаткичи жавоб бериб, мувозанатдан чиқиб кетган бу икки кўрсаткични барқарор ҳолатга кайтаради ва ушбу жараённинг 94% шок содир бўлган чоракда рўй беради.

Ўзбекистон Республикаси давлат статистика қўмитаси 2000 йилнинг апрелидан бошлаб Ўзбекистонда уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатларини ҳисоблашда янги методология асосида тайёрланган сўровномалар орқали амалга ошириш йўлга қўйилди. Ўзбекистон ЯИМ ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражати кўрсаткичлари бўйича эса моделда фойдаланилган давр 1995-2003 йилларни ўз ичига қамраб олган. Демак, кўрсаткичлар турлича методологиялар бўйича ҳисобланган. Бу ҳолат амалга оширилган регрессион таҳлил натижаларига салбий таъсир қилиши табиий.

Энди, Канада ва Корея Республикаси тажрибаларига таянган ҳолда, Ўзбекистон учун юқори иктисодий ўсишга эришиш учун истеъмол (шу жумладан давлат ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатлари) нинг ялпи ички маҳсулотдаги лозим бўлган оптимал улушини аниқлаб қўрайлик (9-жадвал).

9-жадвал. Кўрсаткичларнинг ЯИМ даги оптимал улуши

	Кўрсаткичларнинг 1% га ўзгариш натижалари								
	DY*	DG*	DH*	DY**	DG**	DH**	DY***	DG***	DH***
DY	4,53	3,34	4,26	1,79	0,003	1,68	4,17	3,21	9,11
DG	5,72	4,9	-	0,4	1,02	-	4,13	4,17	-
DH	3,76	-	4,55	0,84	-	1,79	12,3	-	11,0

Бунда:

\* Давлат истеъмол ҳаражатининг ЯИМ даги улуши 18,5%, уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатининг ЯИМ даги улуши 53,8% (кўрсаткичларнинг жорий йилдаги ҳақиқий қиймати).

\*\* Давлат истеъмол ҳаражатининг ЯИМ даги улуши 10,0%, уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатининг ЯИМ даги улуши 55,0%.

\*\*\* Давлат истеъмол ҳаражатининг ЯИМ даги улуши 14,0%, уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатининг ЯИМ даги улуши 56,0%.

Эслатма. Халқаро валюта фонди ва Ўзбекистон Республикаси Иқтисодиёт вазирлиги маълумотлари асосида муаллиф томонидан ҳисобланди.

Ўзбекистон давлат истеъмол ҳаражатларини 10 фоизга туширсак, мамлакатимизда 0,3 фоиз иктисодий ўсишга эришар эканмиз. Давлат ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатларининг ЯИМдаги турли улушлари бўйича амалга оширилган тест натижалари, Ўзбекистон бўйича уларнинг оптимал улуши 14 (давлат истеъмол ҳаражати) ва 56 (уй хўжаликлари истеъмол ҳаражати) фоиз эканлиги аниқланди. Демак, Ўзбекистоннинг бугунги кун

шароитида 10 ва ундан ортиқ фоиз иқтисодий ўсишга эришиш учун жорий давлат истеъмол харажатларини 4,5 фоизга қисқартиришимиз ва уй хўжаликлари истеъмол харажатларини 2,2 фоизга кўпайтиришимиз лозим бўлади. Давлат истеъмол харажатларини қисқартириш учун, Корея Республикасидаги каби, давлат улуши мавжуд, молиявий ночор, стратегик аҳамиятга эга бўлмаган корхоналарни хусусийлаштириш лозим бўлади. Уй хўжаликлари истеъмол харажатларини кўпайтириш учун Марказий банкнинг қайта молиялаштириш ставкаси инструменти орқали уни камайтириш эвазига эришиш мумкин бўлади.

Учта турли давлатларнинг кўрсаткичлари бўйича тест натижалари умумийликка эга бўлиб, улар бир-бирига нисбатан узок муддатли ижобий боғланишга эга эканлигини далолат бermoқда. Канада, Корея Республикаси ва Ўзбекистон кўрсаткичлари бўйича таҳлиллар улардаги уй хўжаликлари истеъмол харажатлари иқтисодий ўсишга давлат истеъмол харажатларига нисбатан юқорироқ ижобий таъсирга эга эканлигини таъкидлайди. Бундан ташқари кўрсаткичларнинг ўтмиш ва жорий даврлардаги ўзгаришлари уларнинг келажақдаги тизимига ҳам таъсир қилиши аниқланди.

### 3. ХУЛОСА

Учта давлат бўйича натижалар пировард иқтисодий назариядаги талабнинг шаклланиш қонуниятини тасдиқламоқда, яъни уй хўжаликлари истеъмол харажатларининг ошиши иқтисоддаги ялпи талабнинг ҳам қўлайишига олиб қелишини ва шу орқали иқтисодий ўсишга сабаб бўлишини ифодаламоқда.

Ҳозирги кунда мамлакатимиз бозор иқтисодига ўтиш босқичини бошидан кечираётган бир пайтда давлатимиз томонидан фискал, монетар ва бошқа сиёсатлар бўйича турли ўзгаришлар амалга оширилиши табиий. Бундай шароитда турли ўзгаришлар сабабли кўрсаткичларнинг келажақдаги тизимини таҳлил қилиш Ўзбекистон макроиқтисоди учун жуда муҳимдир. Чунки макроиқтисодий сиёсатда йўл қўйилган кичик бир ҳатолик мамлакатнинг иқтисодий юксалиш даврини орқага тортиб кетиши мумкин. Шунинг учун ҳам Йохансен методологиясининг макроиқтисодий кўрсаткичлар таҳлиллари учун амалда кенг қўлланилиши кейинги даврларда иқтисодда содир бўладиган ўзгаришлар тизимини аниқлаш имкониятини беради.

Макроиқтисодий кўрсаткичларни таҳлил қилишдаги муаммоларни ҳал этиш, қолаверса, мазкур кўрсаткичларнинг МҲТ да янада аниқроқ ва самаралироқ шаклланишини таъминлаш ҳамда илмий ишдаги натижаларни инобатга олиб, мамлакатимизда қуйидагиларни амалга ошириш жуда ҳам муҳимдир:

1. Макроиқтисоддаги яширин, ноқонуний ва норасмий иқтисодий фаолиятни чуқурроқ таҳлил қилиш лозим. Бунда бугунги кунга қадар макроиқтисодий кўрсаткичлар таркибида мужассамланмай, ўз аксини топмай қолаётган иқтисодий фаолият турларни аниқлаб, уларни чуқур таҳлил қилиб ҳисобга олиш керак.

2. Таҳлил асосида бугунги кунда яширин ва ноқонуний иқтисодий фаолиятнинг макроиқтисодий кўрсаткичларда мужассамланмай қолаётганлигининг асосий сабабларини аниқлаш лозим. Масалан, яширин фаолиятнинг иқтисоддаги мавқеига маълум даражада таъсир қиладиган омиллардан бири – солиқ ставкалари ҳисобланади. Шунинг учун барқарор иқтисодий ўсишга ижобий таъсир этишини таъминлайдиган оптимал солиқ ставкаларини аниқлаш ҳамда жорий қилиш.

3. «Ҳисобга олинмаган иқтисод»нинг бошқа манбалари (масалан, қонунни муҳофаза қилиш вазирликлари ва идораларининг статистик маълумотлари) да ақс эттирилишини ўрганиб чиқиб, уларни тақомиллаштириш ҳамда ҳукумат идоралари ўртасидаги ўзаро алоқаларни кучайтириш, шаклланган маълумотларни МХТ да самарали ифода этиш керак.

4. Ижтимоий сўровномаларда тўпланган маълумотлардан нафақат уй хўжалиқларининг турмуш тарзини таҳлил қилишда, балки солиқ, бож, пул-кредит ҳамда қонунни ҳимоя қилишга қаратилган турли сиёсатларни шакллантиришда, уларни амалда қўллашда ҳам фойдаланиш керак.

5. Иқтисодда содир бўладиган жараёнлар (инфляция, иқтисодий ўсиш ва бошқалар) нинг келажақдаги тизимини ўрганишда ижтимоий сўровномаларни яратиш ва уларни амалда қўллашни жорий этиш лозим. Маълумки, омма орасида иқтисодий ўсиш, инфляция ва ишсизлик даражаларининг келажақдаги тизими ҳақида турли хил фикрлар бўлади. Мазкур кўрсаткичларнинг келажақдаги ҳақиқий қийматининг маълум қисминигина илмий тадқиқотлар орқали ифодалаш мумкин. Кенг омманинг кўрсаткичлар қиймати ҳақидаги фикрларини тўплаб, уни аналитик йўллар ёрдамида ҳисобланган қийматлар билан мужассамлаган ҳолда ягона моделни шакллантириш лозим. Бу орқали кўрсаткичларнинг ҳақиқий қийматларини аниқроқ ҳасоблашга эришиш мумкин.

6. Ўзбекистонда макроиқтисодий кўрсаткичларнинг келажақдаги тизимини таҳлил қилишда фақатгина анъанавий усуллардан эмас, балки бугунги кунда энг оммабоп, самарали эконометрик ва статистик усуллардан, хусусан, Йохансен таҳлилидан фойдаланишни жорий этиш керак. Ушбу усул билан иқтисодий ўзгаришларга бой шароитда ҳам макроиқтисодий кўрсаткичларнинг келажақдаги тизимини аниқлаш мумкин.

7. Статистик усуллар ёрдамида иқтисодий ўзгариш ва жараёнларни таҳлил қилишда, уларнинг келажақдаги тизимини аниқлашда ҳам аналитик, ҳам ижтимоий сўровномалар усулини ўз ичига оладиган регрессион моделни яратиш лозим. Чунки у ёки бу иқтисодий жараён бўйича сўровномаларда аҳоли ўз фикрини билдираётганда фойдаланадиган айрим маълумотлар ва асослар аналитик моделларда ўз ифодасини топмаслиги мумкин. Шунинг учун иқтисодий жараённинг келажақдаги тизимини янада самаралироқ аниқлашда ҳам аналитик, ҳам сўровномалар маълумотига асосланган умумий таҳлилни мамлакатимизда жорий этиш жуда муҳим аҳамиятга эга.

8. Ўзбекистонда 10 ва ундан ортик фоиз иқтисодий ўсишга эришиш учун давлат ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатларининг ЯИМдаги улушлари 14 (давлат истеъмол ҳаражати) ва 56 (уй хўжаликлари истеъмол ҳаражати) фоиз бўлиши лозим.

#### 4. ЧОП ЭТИЛГАН ИЛМИЙ ИШЛАР РЎЙХАТИ

##### 1. Илмий мақолалар:

1. Взаимоотношения между государственными потребительскими расходами и внутренним валовым продуктом. // Экономика и класс собственников. -Т.: 2002, №3, С. 21-23.

2. Уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатлари ва иқтисодий ўсиш муносабатлари. // Ўзбекистон иқтисодий ахборотномаси. -Т.: 2002, №10-11, 59-61 б.

3. Йохансен коинтеграцион тести ва унинг асосида истиқболлаш. // Ўзбекистон иқтисодий ахборотномаси. -Т.: 2003, №7, 2-5 б.

4. Монетарная политика: какой подход оптимальнее? // Экономика и класс собственников. -Т.: 2003, №3, С. 36-37.

5. ЯИМда «ҳисобга олинмаган иқтисод»ни шакллантириш самарадорлигини ошириш. // Бозор, пул ва кредит. -Т.: 2003, №10, 54-56 б.

##### 2. Маърузалар тезислари:

1. “Истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишнинг статистик тадқиқот усуллари тақомиллаштириш” (МХТ асосида). Ҳорижда таълим олган ёш мутахассисларнинг I конференцияси. Т.: 2003. 240-246 б.

Тадқиқотчи:



Иқтисод фанлари номзоди илмий даражасига талабгор

ДЖАЛИЛОВ ХУРШИД АБДУРАҲИМОВИЧнинг

08.00.06 – “Эконометрика ва статистика” ихтисослиги бўйича “Истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишнинг статистик тадқиқот усулларини такомиллаштириш” (МХТ асосида) мавзусидаги диссертациянинг

### **ҚИСҚАЧА МАЗМУНИ**

**Калитли сўзлар.** Ялпи ички маҳсулот, давлат ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатлари, эконометрик моделлаштириш, тренд, мавсумийлик, тасодифийлик, даврийлик хусусиятлари.

**Тадқиқот объекти** бўлиб Ўзбекистон Республикаси миллий иқтисоди ҳисобланади. Кўрсаткичлар ўртасидаги боғланишни аниқлашда Канада ва Корея Республикаси давлатларининг маълумотларидан ҳам фойдаланилган.

**Ишнинг мақсади.** Истеъмол ҳаражатлари ва ЯИМ ўртасидаги боғланишни ўрганишда хорихда қўлланиладиган замонавий эконометрик усулларни Ўзбекистон Республикаси шароитида қўллаш ва кўрсаткичлар тизимини ишлаб чиқиш.

**Тадқиқот усуллари:** тизимли таҳлил, эконометрик моделлаштириш, статистик ва иқтисодий таҳлил усуллари.

**Олинган натижалар ва уларнинг янгилиги.** Бозор муносабатларига ўтиш шароитида истеъмол сарфлари ва ЯИМ кўрсаткичларининг МХТда аниқроқ шаклланишидаги муаммолар тадқиқ қилинган. Ўзбекистон иқтисодида давлат ва уй хўжаликлари истеъмол ҳаражатларининг ЯИМ билан боғланиши хорихда замонавий ҳисобланган усуллар ёрдамида аниқланган. Истеъмол сарфлари ва ЯИМ ўртасидаги боғлиқликни тавсифлайдиган эконометрик моделлар ишлаб чиқилган.

**Амалий аҳамияти.** Диссертацияда ишлаб чиқилган илмий тавсиялар иқтисодий тизимларни бошқаришда вужудга келиши мумкин бўлган муаммоларнинг асосий сабабларини, хусусан даромаднинг мутаносиб равишда тақсимланиши, макроиқтисодий кўрсаткичлар тизимидаги ўзгаришлар сабабларини очиб беришга, пировардда эса республикамизда иқтисодий стратегиянинг мақбул йўналишларини танлаб олиниш имконини беради.

**Тадбиқ этиш даражаси.** Тадқиқотнинг илмий натижалари Ўзбекистон Республикаси Иқтисодиёт вазирлигида жорий этилган. Синов натижалари ишлаб чиқилган тизим миллий иқтисодни бошқаришда илмий асосланган қарорлар қабул қилишда муҳим ва ишончли восита бўлиб хизмат қилади.

**Амалга қўллаш соҳаси.** Мамлакат макроиқтисодий фаолият натижаларини таҳлил қилиш ва шу кўрсаткичларнинг келажакдаги истиқболини аниқлаш соҳаларида қўлланилади.

## РЕЗЮМЕ

диссертации Джалилова Хуршида Абдурахимовича на тему  
 «Совершенствование методов исследования взаимосвязи между  
 потребительскими расходами и ВВП» (на основе СНС) на соискание ученой  
 степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.06 –  
 «Эконометрика и статистика»

**Ключевые слова.** Валовой внутренний продукт, потребительские расходы государства и домохозяйств, эконометрическое моделирование, тренд, сезонность, случайность, цикличность.

**Объектом исследования** является национальная экономика Республики Узбекистан. При исследовании взаимосвязи между показателями также использована информация о Канаде и Республике Корея.

**Цель работы.** Разработка системы показателей и внедрение современных эконометрических методов исследования взаимосвязи между потребительскими расходами и ВВП.

**Метод исследования.** Методы системного анализа, эконометрического моделирования, статистического и экономического анализа.

**Полученные результаты и новизна.** Исследованы проблемы более точного формирования показателей потребительских расходов и ВВП в СНС в условиях перехода к рыночным отношениям. С помощью современных зарубежных методов найдены отношения между потребительскими расходами государства и домохозяйств с ВВП. Разработаны эконометрические модели, характеризующие взаимосвязи между потребительскими расходами и ВВП.

**Практическая значимость работы.** Разработанные в диссертации научные предложения дадут возможность выявить основные причины возникающих проблем в ходе управления экономических систем, в частности неравномерного распределения доходов, что позволит выбрать соответствующие пути экономической стратегии республики.

**Уровень внедрения и экономическая эффективность.** Научные результаты исследования внедрены в Министерстве экономики Республики Узбекистан. Результаты тестирования доказали, что разработанная экономическая система является важным и достоверным инструментом в ходе управления национальной экономикой и принятия научно-обоснованных решений.

**Область применения.** Анализ и прогнозирование макроэкономических показателей государства.

### Resume

on the dissertation work of Djalilov Khurshid Abdurakhimovich on the theme “Research methods development of the relationship between consumption expenditures and GDP” (on the base of SNA) for getting the degree of candidate of economic sciences, specialty 08.00.06 – “Econometrics and statistics”

**Key words.** Gross domestic product, government consumption expenditures, household consumption expenditures, econometric modeling, trend, seasonality, random walk, cycle.

**The subject of research:** are the national economy of the Republic of Uzbekistan. During the research information on Canada and Republic of Korea was used as well.

**The goal of research:** working out the system of indicators and the application of modern foreign econometric methods of relationship investigation between consumption expenditures and GDP.

**Method of research:** system analysis, econometric modeling, statistic and economic analysis.

**Obtained results and novelty.** Investigated the problems of more accurate formation of consumption expenditures and GDP in the SNA during the transition to market economy. Found out the relationship of government and households' consumption expenditures with GDP by using modern foreign methods. Worked out econometric models, explaining the relationship between consumption expenditures and GDP.

**Practical importance of the research.** worked out scientific proposals In dissertation provides the opportunity finding out the main reasons in managing over the economic system, particularly uneven distribution of income, choosing the acceptable ways of economic strategy of the country.

**Application degree and economic efficiency:** scientific results of the research are applied in the Ministry of economy of the Republic of Uzbekistan. The testing results proved that worked out economic system is important and trustful instrument during managing over national economy and accepting scientific proved solutions.

**Sphere of usage.** In analyzing the results of macroeconomic activity of the country and their forecasting spheres.



Қоғоз бичими	1,2 б.т.
Босишга рухсат этилди	06.10.2004 й.
Адади	100 нусха
Буюртма №	13-10

Ўзбекистон Республикаси президенти ҳузуридаги  
Давлат ва жамият қурилиши академиясининг  
«Академхизмат» босмахонасида чоп этилди.

Тошкент, Ўзбекистон  
шоҳ кўчаси, 45.