

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشگاه آزاد اسلامی
واحد تهران مرکزی
دانشکده اقتصاد و حسابداری

پایان نامه برای دریافت درجه کارشناسی ارشد (M.A)
گرایش: برنامه ریزی و توسعه اقتصادی

عنوان:

بررسی عوامل موثر بر صادرات در صنایع ایران با تاکید بر ساختار بازار

استاد راهنما:

دکتر غلامرضا عباسی

استاد مشاور:

دکتر محمد رضا میرزائی نژاد

پژوهشگر:

فهیمة دنیابین سرخابی

تابستان 1391

تقدیم به :

سیاوش عزیز

تشکر و قدردانی :

قبل از هر چیزی از تلاشهای ارزنده پدر و مادرم تشکر و قدردانی می نمایم چرا که در سایه حمایتهای آنها مراحل زندگی و تحصیل را بی دغدغه به ای نجا رسانیده ام. از استاد راهنمای این پایان نامه جناب دکتر عباسی و استاد مشاور جناب دکتر میرزایی نژاد به خاطر کمکهای بی دریغشان سپاسگذارم. اما در نهایت از همسر عزیزم که صبورانه ساعت‌های بی حوصله گی ام را تحمل و در تهیه و تدوین مطالب یاریم کرد کمال تشکر را دارم.

تعهد نامه اصالت پایان نامه کارشناسی ارشد

اینجانب فهیمه دنیابین سرخابی دانش آموخته مقطع کارشناسی ارشد ناپیوسته به شماره دانشجویی 89093706700 در رشته علوم اقتصادی- برنامه ریزی و توسعه اقتصادی که در تاریخ 1391/06/19 از پایان نامه خود تحت عنوان: بررسی عوامل موثر بر صادرات در صنایع ایران با تاکید بر ساختار بازار با کسب نمره 19/5 و درجه عالی دفاع نموده ام بدینوسیله متعهد می شوم:

- 1 - این پایان نامه حاصل تحقیق و پژوهش انجام شده توسط اینجانب بوده و در مواردی که از دستاوردهای علمی و پژوهشی دیگران (اعم از پایان نامه، کتاب، مقاله و...) استفاده نموده ام، مطابق ضوابط و رویه های موجود، نام منبع مورد استفاده و سایر مشخصات آن را در فهرست ذکر و درج کرده ام.
- 2 - این پایان نامه قبلاً برای دریافت هیچ مدرک تحصیلی (هم سطح، پایین تر یا بالاتر) در سایر دانشگاهها و موسسات آموزش عالی ارائه نشده است.
- 3 - چنانچه بعد از فراغت از تحصیل، قصد استفاده و هر گونه بهره برداری اعم از چاپ کتاب، ثبت اختراع و از این پایان نامه داشته باشم، از حوزه معاونت پژوهشی واحد مجوزهای مربوطه را اخذ نمایم.
- 4 - چنانچه در هر مقطع زمانی خلاف موارد فوق ثابت شود، عواقب ناشی از آن را بپذیرم و واحد دانشگاهی مجاز است با اینجانب مطابق ضوابط و مقررات رفتار نموده و در صورت ابطال مدرک تحصیلی ام هیچگونه ادعایی نخواهم داشت.

نام و نام خانوادگی: فهیمه دنیابین سرخابی

تاریخ و امضاء

بسمه تعالی

در تاریخ: 1391/06/19

دانشجوی کارشناسی ارشد خانم فهیمه دنیابین سرخابی از پایان نامه خود دفاع نموده و با نمره 19/5 بحروف و با درجه عالی مورد تصویب قرار گرفت .

امضاء استاد راهنما:

نظر استاد راهنما برای چاپ در پژوهش‌نامه دانشگاه

مناسب است _____
تاریخ و امضاء: مناسب نیست

فهرست مطالب

1 فصل اول: کلیات تحقیق.....

- 1-1 مقدمه 2
- 2-1 بیان مساله تحقیق 3
- 3-1 اهداف تحقیق 5
- 4-1 اهمیت موضوع 5
- 5-1 سوالات و فرضیه های تحقیق 6
- 6-1 چهارچوب نظری تحقیق 7
- 7-1 مدل تحقیق 10
- 8-1 تعاریف عملیاتی متغیرها و واژه های کلیدی 11
- 9-1 روش تحقیق 11
- 10-1 قلمرو تحقیق 12
- 11-1 جامعه آماری 12
- 12-1 چهارچوب بررسی 13

15 فصل دوم: ادبیات موضوع.....

- 1-2 مقدمه 16
- 2-2 مرکانتالیستها 16
- 3-2 مزیت طبیعی 18
- 1-3-2 مزیت مطلق آدام اسمیت 18
- 2-3-2 مزیت نسبی از دیدگاه ریکاردو 19
- 4-3-2 نظریه هکشر - اوهلین 22
- 5-3-2 نظریه کراویس 23
- 6-3-2 معمای لیانتیف 23
- 7-3-2 نظریه استاپر - ساموئلسون 25

26.....	مزیت اکتسابی	4-2
26.....	نظری سرمایه و مهارت‌های انسانی	1-4-2
28.....	نظریه شباهت ترجیحات	2-4-2
29.....	نظریه برگشت تقاضا	3-4-2
30.....	الگوی پیشرفت و شکاف تکنولوژی	4-4-2
31.....	الگوی چرخه تولیدی	5-4-2
33.....	نظری شکاف تکنولوژی	6-4-2
34.....	نظری مزیت رقابتی	7-4-2
36.....	نظری شومپتر	8-4-2
38.....	مطالعات انجام شده در سطح جهانی	5-2
38.....	تعین کننده های عملکرد صادرات پاکستان (2009)	1-5-2
40.....	هزینه R&D، رقابت داخلی و عملکرد صادراتی بنگاه‌های ژاپن (1993)	2-5-2
41.....	عملکرد صادرات در صنایع آفریقا و آسیا (2002)	3-5-2
42.....	فشار واردات و عملکرد صادرات در کشورهای در حال توسعه (1989)	4-5-2
43.....	مدل ترکیه (ارکان یا گور، 1987)	5-5-2
46.....	تخمین تابع تقاضای صادرات برای کشور بنگلادش (1992)	6-5-2
48.....	مطالعات تجربی در ایران	6-2
48.....	اثر سرمایه گذاری در تحقیق و توسعه بر صادرات در ایران (1389)	1-6-2
50.....	بررسی رابطه تعاملی کوتاه مدت و بلند مدت تورم و عرضه صادرات غیر نفتی در ایران	2-6-2
51.....	بررسی تاثیر سیاست های ارزی در توسعه صادرات غیر نفتی کشور	3-6-2
52.....	عوامل تعیین کننده صادرات غیر نفتی در ایران	4-6-2
54.....	عوامل تعیین کننده صادرات در ایران (1383)	5-6-2
55.....	صادرات غیر نفتی در مدل برنامه سوم توسعه اقتصادی اجتماعی (1378)	6-6-2
59.....	نتیجه گیری	7-2
61.....	فصل سوم : بررسی سریاستهای تجاری و صادرات غیر نفتی	
62.....	مقدمه	1-3

63.....	2-3	روند سلیسهای تجاری در جهان
65.....	3-3	بررسی روند کلی سیاستهای تجاری در ایران
65.....	1-3-3	دوره قبل از انقلاب اسلامی
67.....	2-3-3	دوره بعد از انقلاب اسلامی
73.....	4-3	بررسی وضعیت صادرات غی نفتی ایران طی دوره (1338-1387)
77.....	5-3	بررسی آمار صادرات صنعتی به تفکیک صنایع طی دوره (1375-1386)
83.....	6-3	نتیجه گیری
84.....		فصل چهارم: تصریح مدل ، روش برآورد و تحلیل نتایج برآورد.....
85.....	1-4	مقدمه
85.....	2-4	تصریح مدل
90.....	3-4	روش تخمین
92.....	4-4	بررسی داده ها
94.....	5-4	تحلیل نتایج حاصل از برآورد الگو
101.....	6-4	نتیجه گیری
102.....		فصل پنجم : نتیجه گیری و پیشنهادات.....
103.....	1-5	مقدمه
104.....	2-5	نتیجه گیری
110.....	3-5	پیشنهادات
110.....	1-3-5	پیشنهادات حاصل از تحقیق
111.....	2-3-5	پیشنهادات برای محققین بعدی
112.....		منابع و ماخذ:
114.....		ضمیمه: نتایج خروجی نرم افزار برای سه سناری
115.....		نتایج برآورد سناری (1) (خروجی نرم افزار)
118.....		نتایج برآورد سناری (2) (خروجی نرم افزار)
121.....		نتایج برآورد سناری (3) (خروجی نرم افزار)

فهرست جداول:

- جدول (1-2) خلاصه نظریات مزیت 37
- جدول (2-2) مروری بر مطالعات داخلی و خارجی مرتبط 58
- جدول (1-3) راهبردهای توسعه و تجاری در برنامه های توسعه کشور 72
- جدول (2-3) آمار صادرات غیررغی رنفی به تفکیک کالا و خدمات طی دوره (1338-1385) 76
- جدول (3-3) میزان، متوسط و تغییرات صادرات صنعتی به تفکیک صنایع درکده های ISIC چهار رقمی 81
- جدول (1-4) بررسی رویکرد تخمین سناری و 1 98
- جدول (2-4) بررسی رویکرد تخمین سناری و 2 99
- جدول (3-4) بررسی رویکرد تخمین سناری و 3 100
- جدول (4-4) نتایج حاصل از برآورد مدل برای سه سناری و 100

فصل اول: کلیات تحقیق

1 + مقدمه

امروزه اقتصاد دانان معتقدند که تجارت آزاد، به افزایش سرمایه گذاریها در جهت مزیت نسبی منجر شده و موجب رشد و توسعه اقتصادی می گردد این درحالی است که نیاز به ارز برای واردات ، صادرات را امری اجتناب ناپذیر می سازد از طرفی اهمیت روز افزون استقلال از درآمدهای نفتی به دلیل نوسانات و بی ثباتی قیمت و تقاضای جهانی نفت که درآمدهای دولت و اقتصاد کشور را به شدت تحت تاثیر عوامل برونزا قرار می دهد باعث شده است تا نقش صادرات غیر نفتی و به ویژه صنعتی فراتر از ابزاری برای کسب درآمدهای ارزی مطرح شود، به نحوی که نظر بسیاری از صاحب نظران و پژوهشگران اقتصاد به سمت تحلیل وضعیت موجود صادرات غیر نفتی معطوف شده و اتخاذ سیاستهایی که اتکا به تک محصولی بودن را کم و موجبات افزایش صادرات غیر نفتی را فراهم سازد ، امری ضروری به نظر می رسد در این میان توجه به تحولات صورت گرفته در نظریه های مزیت و مطالعات خارجی انجام شده در خصوص عوامل موثر بر صادرات صنعتی حکایت از آن دارد که علاوه بر متغیر های کلان اقتصادی ، متغیر های خرد (مخارج تحقیق و توسعه و اندازه بنگاه ..) به ویژه ساختار بازار نقش مهمی در میزان صادرات صنایع ایفاء می نماید این در حالیست که مطالعه ای

با این رویکرد برای صادرات صنایع ایران صورت نگرفته و اهمیت مطالعه در این خصوص را دو چندان می نماید .

1 2 بیان مساله تحقیق

بررسی آمار و ارقام صادرات غیر نفتی نشان می دهد در صورتی که درآمدهای نفتی از اقتصاد ایران حذف گردند، این میزان صادرات جوابگوی تامین ارز مورد نیاز برای تامین کالاهای ضروری وارداتی نخواهد بود. در این میان تمرکز اکثر مطالعات تجربی که به بررسی عوامل موثر بر صادرات پرداخته اند بر متغیرهای کلان اقتصادی از جمله نرخ ارز و واردات جهانی بوده است که از آن جمله می توان به مطالعات انجام شده توسط نوفرستی و عرب مازار (1373)، هادیان و طاهری (1377)، ابریشمی (1380)، شاکری (1383) اشاره نمود همچنین در مدل‌های ارائه شده برای برنامه های توسعه اقتصادی صادرات غیر نفتی تابعی از نسبت نرخ ارز در بازار آزاد به نرخ ارز رسمی منظور شده است این درحالیست که تغییر و تحولات در نظریات مزیت سبب شده علاوه بر متغیرهای کلان اقتصادی دلایل خرد اقتصادی برای افزایش میزان صادرات نیز در مطالعات مد نظر قرار گیرد به اینصورت که در تئوریهای سنتی تجارت مثل تئوری مزیت نسبی ریکاردو و هکچر - اوهلین این فرض که بنگاهها در صنعت همگن می باشند مدنظر بوده است . اما امروزه مدل‌های تجارت بر پایه نظریه کروگمن¹ شکل گرفته که نقش ویژگیهای بنگاه ها را در تصمیمات تجاری و تولید بارز می داند. علاوه بر این

¹ - krugman,P.,(1980)

تحولات جهانی شدن و سرعت افزایش ارتباطات حتی بنگاههای کوچک را قادر ساخته که برای کسب سود به بازار های هدف دسترسی داشته باشند ضمن اینکه ایجاد بانکهای اطلاعاتی در خصوص داده های خرد و پیشرفت تکنیکهای محاسباتی تحقیقات تجربی در سطح خرد را تسهیل نموده است. از جمله مطالعات انجام شده برای صادرات در سطح بنگاه و زیر گروه های صنعتی می توان به بررسی های صورت گرفته توسط مصلح الدین ، اعجاز قانی و محمود تاریک (2009)¹ برای صنایع پاکستان ، کیوهیکو ایتو ، ولادمیر پاکیک (1993)² برای صنایع ژاپن و آلبرت زو فاک (2002)³ برای صنایع آفریقا اشاره نمود که در این مطالعات تغییرات در صادرات به عواملی چون سن بنگاه ، نوع مالکیت ، سطح تکنولوژی ، توانایی مدیریت و درجه رقابت بازار، هزینه های انجام شده در واحد تحقیق و توسعه نسبت داده شده است.

در این میان با توسعه نظریات مزیت برای تبیین واقعیات تجارت بین الملل ، مزیت رقابتی توسط پورتر (1990)⁴ مطرح شده است که محیط فعالیت و ساختار بازار را عامل موثری در رقابت پذیری بنگاهها در سطح بین الملل می داند در این مطالعه ضمن مروری بر نظریات مزیت و مطالعات انجام شده در خصوص صادرات صنعتی سعی خواهد شد علاوه بر متغیر های کلان ، اثر گذاری متغیر های خرد از جمله اندازه بنگاه ، هزینه های تحقیق و توسعه و .. نیز بر صادرات صنعتی در ایران مورد بررسی قرار گرفته و با عنایت به نظریه پورتر، نقش ساختار بازار (درجه رقابتی) بر صادرات صنعتی تحلیل و مشخص شود .

¹ - Musleh Ud Din , Ejaz .Ghai, and Tariq. Mahmood, (2009)

² -Ito.Kiyohiko& Pakik V. (1993)

³ - Zeufack .Albert,(2002)

⁴ - Porter, Micheal E

1 3 اهداف تحقیق

هدف اصلی:

تعیین عوامل موثر بر صادرات صنعتی در ایران با توجه به ساختار بازار

اهداف جزئی:

1 بررسی میزان صادرات در صنایع مختلف به تفکیک کدهای ISIC چهار رقمی

2 بررسی ساختار بازار در صنایع مختلف به تفکیک کدهای ISIC چهار رقمی

3 -شناسایی عوامل موثر بر صادرات صنعتی در ایران

1 4 اهمیت موضوع

امروزه اقتصاد دانان معتقدند که تجارت آزاد، به افزایش سرمایه گذاریها در جهت مزیت نسبی منجر شده، و موجب رشد و توسعه اقتصادی می گردد این درحالی است که نیاز به ارز برای واردات، صادرات را امری اجتناب ناپذیر می سازد از طرفی اهمیت روز افزون استقلال از درآمدهای نفتی به دلیل نوسانات و بی ثباتی قیمت و تقاضای جهانی نفت که درآمدهای دولت و اقتصاد کشور را به شدت تحت تاثیر عوامل برونزا قرار می دهد باعث شده است تا نقش صادرات غیر نفتی و به ویژه صنعتی فراتر از ابزاری برای کسب درآمدهای ارزی مطرح شود، به نحوی که نظر بسیاری از صاحب نظران و پژوهشگران اقتصاد به سمت تحلیل وضعیت موجود صادرات غیر نفتی معطوف شده

است. بنابراین اتخاذ سیاستهایی که اتکا به تک محصولی بودن را کم و موجبات افزایش صادرات غیر نفتی را فراهم می سازد ، امری ضروری به نظر می رسد در این میان توجه به تحولات صورت گرفته در نظریه های مزیت و مطالعات خارجی انجام شده در خصوص عوامل موثر بر صادرات صنعتی حکایت از آن دارد که علاوه بر متغیر های کلان اقتصادی ، متغیر های خرد (مخارج تحقیق و توسعه و اندازه بنگاه ..) به ویژه ساختار بازار نقش مهمی در میزان صادرات صنایع ایفاء می نماید این در حالیست که مطالعه ای با این رویکرد برای صادرات صنایع ایران صورت نگرفته و اهمیت مطالعه در این خصوص را دو چندان می نماید .

1 5 سوالات و فرضیه های تحقیق

- سوالات تحقیق:

- 1 - آیا بین درجه رقابتی بازار و صادرات صنعتی رابطه معنی داری وجود دارد؟
- 2 - آیا هزینه تحقیق و توسعه در صادرات صنعتی موثر است؟
- 3 - آیا میزان سرمایه انسانی بر صادرات صنعتی موثر است؟

- فرضیه های تحقیق:

- 1 - افزایش در درجه رقابت بازار، موجب افزایش صادرات می شود.
- 2 - افزایش در هزینه تحقیق و توسعه برای صنایع ، سبب افزایش صادرات می شود.

1 6 چهارچوب نظری تحقیق

بنا به نظریه آدام اسمیت که نظریه مزیت مطلق را ارائه نمود هر کشوری در تولید کالا یی که در آن کارایی بیشتری دارد تخصص می یابد و این تخصص موجب تولید مازاد بر مصرف داخلی گشته و این امر امکان مبادله این نوع کالا را فراهم می آورد . دیوید ریکادو بعد از اسمیت به تکمیل و بسط نظریات وی پرداخت و نظریه مزیت نسبی را مطرح نمود به عقیده وی چنانچه کشوری در تولیدات خود از مزیت مطلق برخوردار نباشد باز هم می تواند وارد جریان مبادلات جهانی شود . الگوی مزیت نسبی ریکاردو توسط سایر اقتصاددانان مورد پلایش قرار گرفت ، اوهلین نظریه ریکاردو را با نظریه دیگری شامل چندین عامل تولید و چارچوب بازارهای تولید و عوامل به هم پیوسته ، جانشین کرد که این نظریه جدید، نظریه هکشر- اوهلین نام گرفت این نظریه شکل متعادل تری از نظریه ریکاردو است و مبنای آن این است که کشورها از تکنولوژی تولیدی یکسان و ذخایر طبیعی متفاوت (زمین ، نیروی کار، منابع طبیعی و سرمایه) بهره برده و عوامل تولید اساس این نظریه هستند . بر اساس این نظریه مزیت نسبی یک کشور در صنعتی ایجاد می شود که گرایش به استفاده بیشتر از آن دسته از عوامل تولیدی دارد که به طور نسبی در آن کشور فراوان ترند. همچنین واردات آن کشور را کالاهایی تشکیل می دهند که مواد اولیه تولید آنها به طور نسبی در آن کشور کمتر می باشند.

در دو دهه 1960 و 1970 نظریه چرخه تولید ورنن¹ از وزن بیشتری نسبت به سایر نظریه های تجارت در این زمان برخوردار بود. وی نظریه خود را نه بر مزیت‌های نسبی حاصل از نسبت عوامل بلکه بر اساس تاثیر فاصله زمانی ابداعات، اثر مقیاس و نقش نبود آگاهی و اطمینان بر الگوهای تجارت بنا می‌کند و ادعا می‌کند بین آگاهی از قواعد علمی و به کارگیری این قواعد در محصولات بازاری شکاف زمانی قابل توجهی وجود دارد.

در دهه 1980 نظریه شکاف تکنولوژی کروگمن از مقبولیت زیادی برخوردار شد. به عقیده وی جریان تجارت در داخل کشورها و در میان کشورهای مختلف بستگی به تفاوت‌های دانش تکنولوژیک این کشورها دارد در سال 1987 رابطه بین تجارت و رشد تکنولوژی به وسیله کروگمن به معرفی مزیت پویا منجر گردید. در این مفهوم مزیت، اکتسابی بوده و همراه با تغییر در موجودی عوامل و فن آوری تغییر می‌کند به کارگیری صرفه های مقیاس، کارایی در تولید و تخصص و مهارت نیز از جمله عواملی هستند که سبب تغییر در مزیت نسبی می‌شوند.

در سیر تکوین نظریه های مزیت دیدگاه دیگری با عنوان مزیت رقابتی توسط "مایکل پورتر" (1990)² مطرح شده است وی معتقد است یک کشور با توجه به ویژگی های خاص خود می‌تواند محیطی را فراهم کند که خلق مزیت رقابتی توسط بنگاه های داخلی، تشویق شود. در نتیجه قادر به تولید و مبادرت به صدور کالاهایی خواهد کرد که متضمن رشد مستمر آن کشور شود. در این دیدگاه بر ماندگاری یک کشور در صحنه رقابت جهانی تاکید می‌شود.

¹ -Vernon(1966)

² - Porter Michel E.(1990)

عاملی که در نظریه مزیت رقابتی نسبت به سایر نظریه ها بیشتر مورد توجه قرار گرفته تاکید بر کارایی و بهره‌وری از طریق ایجاد فضای رقابتی است. پورت معتقد است که رقابت داخلی موجب افزایش کارایی بنگاهها و در نتیجه ارتقا توانایی آنها برای رقابت در سطح بین الملل و بنگاههای خارجی خواهد شد. اما آنچه مسلم است رقابتی که در این بحث مطرح است رقابت مبتنی بر دیدگاه نئوکلاسیک نیست.

در دیدگاه مکتب نئوکلاسیک درجه رقابت براساس تعداد بنگاههای مشابه و نه براساس رفتار رقابتی تعیین می شود. در حالی که مخالفین این نظریه معتقدند که این وضعیت اساساً درگیر هیچ رقابتی نیست در این راستا شومپتر و هایک¹ رقابت را یک فرآیند پویا می دانند که طی آن روشهای تولید و محصولات برتر معرفی می شوند. در این خصوص شومپتر اصطلاح "تخریب آفریننده"² را به فرآیند رقابت نسبت می دهد و معتقد است که رقابت در درون خود نیروی محرک و پیش برنده‌ای به نام ابداع و نوآوری دارد. بنگاهها از طریق نوآوری و ابداع می توان هزینه های خود را کنترل نمایند و به کیفیت بهتری دست یافته و از این رو بقای خود را در فضای رقابتی و در سطح بین الملل تضمین نمایند.

نکته مهم از نظر شومپتر و به طور کلی در این دیدگاه ضرورت وجود درجه‌ای از انحصار در ساختار بازار برای شکل گیری چنین فرآیندی از رقابت است چرا که قدرت انحصاری به مفهوم توانایی جذب سود حاصل از معرفی محصولات برتر و روشهای جدید بوده و منابع لازم را در اختیار انحصارگر

¹ - Schumpeter, J. (1944) And Hayek, F. A. (1948)

² - Creative destruction