



دانشکده اقتصاد، مدیریت و علوم اجتماعی

پایان نامه کارشناسی ارشد در رشته اقتصاد

بررسی اثر ویژگی های شرکای تجاری بر تجارت خارجی ایران
کاربرد مدل جاذبه

توسط
زهرا تجلی

استاد راهنما
دکتر حسین مرزبان

شهریور ۱۳۸۹

اللَّهُمَّ
صَلِّ عَلَى مُحَمَّدٍ
وَعَلَى آلِهِ
وَالْحَقُّ عَلَى
الْبَاطِلِ
وَالْحَقُّ عَلَى
الْبَاطِلِ
وَالْحَقُّ عَلَى
الْبَاطِلِ
وَالْحَقُّ عَلَى
الْبَاطِلِ
وَالْحَقُّ عَلَى
الْبَاطِلِ
وَالْحَقُّ عَلَى
الْبَاطِلِ

اظهار نامه

اینجانب زهرا تجلی به شماره دانشجویی (۸۶۰۴۷۹) دانشجوی رشته علوم اقتصادی گرایش محض دانشکده علوم اجتماعی اظهار می کنم که این پایان نامه حاصل پژوهش خودم بوده و در جاهایی که از منابع دیگری استفاده کرده ام نشانی دقیق و مشخصات کامل آن را نوشته ام. همچنین اظهار می کنم که موضوع پایان نامه ام تکراری نیست و تعهد می نمایم بدون مجوز دانشگاه دستاوردهای آن را منتشر ننموده و یا در اختیار غیر قرار ندهم. کلیه حقوق این اثر مطابق با آیین نامه فکری و معنوی متعلق به دانشگاه شیراز می باشد.

نام و نام خانوادگی: زهرا تجلی

تاریخ و امضاء: شهریور ۱۳۸۹

تقدیم به

پدر عزیزم که مسیر سربلندی را به شیواترین روش به من آموخت
و مادر عزیزم که دامن گهربارش لحظه های مهربانی را به من آموخت

و همسرم، عزیزترین و بهترین همراه زندگیم

تقدیم به آنهایی که مرا در این راه حمایت کردند

سپاسگزاری

سپاس خداوند متعال را که خلعت سیادت و سعادت بر انسان پوشانید
و فرصت زیستن و تحصیل علم را به وی عطا فرمود.
سپاس بیکران او را که توفیق قدم گذاشتن در وادی علم و معرفت را به من ارزانی فرمود.

اکنون که در سایه لطف حضرت حق این رساله به اتمام رسید از استاد عالم و فرهیخته ام
جناب آقای **دکتر حسین مرزبان** که در تمام مراحل پژوهش با راهنمایی هایشان همراه و
همگام بودند نهایت تشکر را دارم. همچنین از استادان مشاورم جناب آقای **دکتر سید
حسین ذوالنور** و جناب آقای **دکتر ابراهیم هادیان** کمال سپاسگزاری را دارم.
برخود لازم می‌دانم از زحمات دوستان گرامی که در انجام این رساله همکاری نمودند تشکر و
قدردانی نمایم.

چکیده

بررسی اثر ویژگی های شرکای تجاری بر تجارت خارجی ایران کاربرد مدل جاذبه

به وسیله ی

زهرا تجلی

هدف از این تحقیق بررسی اثر ویژگی های شرکای تجاری بر تجارت خارجی ایران با استفاده از داده های تلفیقی که شامل ۳۰ کشور طی ۹ سال در بازه زمانی ۲۰۰۹-۲۰۰۱ می باشد. شرکای تجاری ایران به دو گروه کشورهای در حال توسعه و توسعه یافته تقسیم بندی می شوند و با استفاده از کاربرد مدل جاذبه، سه متغیر وابسته کل تجارت دو جانبه، صادرات نفتی و صادرات غیر نفتی مورد بررسی قرار می گیرند. همچنین از آنجا که در ایران و بسیاری از شرکای تجاری آن نرخ ارز در بازار تعیین نمی شود بر آن شدیم که تأثیر سیاست ارز را بر مبادلات فی ما بین کشورها مورد بررسی قرار دهیم. بنابراین نوسانات نرخ ارز، برای تشخیص سهم آن در جریان تجارت دو جانبه در قالب مدل جاذبه معرفی می شود. همچنین تخمین با بهره گیری از داده های تلفیقی و تکنیک حداقل مربعات معمولی برآورد می شود.

براساس نتایج تحقیق، خصوصیات مشترک کشور ایران و کشورهای در حال توسعه کمکی به تجارت دو جانبه این کشورها نمی کند. در مقابل با وجود ویژگی های متفاوت بین ایران و کشورها توسعه یافته، کشور ایران تمایل به تجارت بیشتر با کشورهای توسعه یافته نشان می دهد. با توجه به تخمین، نرخ ارز واقعی در مدل جاذبه بیان کننده رابطه معکوس این متغیر با جریان تجارت بین ایران و شرکای تجاری آن می باشد.

کلید واژه: مدل جاذبه، تجارت جنوب- جنوب، تجارت شمال- جنوب

فهرست مطالب

عنوان	صفحه
فصل اول: مقدمه	
۱-۱. اهمیت و ضرورت تحقیق	۳
۲-۱. هدف تحقیق	۴
۳-۱. سوالات تحقیق	۵
۴-۱. روش تحقیق	۵
فصل دوم	
۲- مروری بر مطالعات انجام شده	۷
۱-۲. مقدمه	۷
۲-۲. مطالعات انجام شده در خارج	۷
۳-۲. مطالعات انجام شده داخلی	۱۵
فصل سوم	
۳- مبانی نظری و ساختار الگو	۱۹
۱-۳. مقدمه	۱۹
۲-۳. تجارت بین الملل	۲۰
۳-۳. نظریه های پایه ای در تجارت بین الملل	۲۰
۱-۳-۳. نظریه مزیت مطلق آدام اسمیت	۲۰
۲-۳-۳. نظریه مزیت نسبی ریکاردو	۲۱
۳-۳-۳. نظریه مزیت نسبی هکشر و اوهلین	۲۲
۴-۳-۳. نظریه تجارت جدید	۲۳
۴-۳. انواع تجارت بین کشورها	۲۴
۵-۳. تجارت شمال - جنوب	۲۶
۶-۳. تجارت جنوب - جنوب	۳۰
۱-۶-۳. تجارت جنوب - جنوب از منظر خرد	۳۳
۲-۶-۳. تجارت جنوب - جنوب از منظر کلان	۳۴
۳-۶-۳. یکپارچگی اقتصادی - منطقه ای و کشورهای جنوب	۳۴

۳۷	۷-۳. مدل اقتصاد سنجی.....
۳۷	۱-۷-۳. معرفی مدل جاذبه.....
۳۹	۲-۷-۳. تئوری های زیر بنایی مدل جاذبه.....
۴۲	۳-۷-۳. متغیر های توضیحی مدل جاذبه.....
۴۳	۴-۷-۳. متغیر های توضیحی اضافه شده به مدل جاذبه.....
۴۴	۵-۷-۳. کاربرد مدل جاذبه در تحلیل های اقتصادی.....
۴۵	۱-۵-۷-۳. اثر درآمد بر تجارت (کشور وارد کننده).....
۴۶	۲-۵-۷-۳. اثر درآمد بر تجارت (کشور صادر کننده).....
۴۷	۳-۵-۷-۳. اثر هزینه های مبادله بر تجارت.....
۴۸	۴-۵-۷-۳. اثر ایجاد تجارت و انحراف تجارت.....
۵۱	۶-۷-۳. استخراج مدل جاذبه.....
۵۳	۷-۷-۳. مدل استفاده شده در تحقیق.....
۵۵	۸-۳. معرفی الگوی داده های پانل.....
۵۶	۱-۸-۳. تخمین الگوی پانل دوطرفه با اثرات تصادفی.....
۵۹	۱-۱-۸-۳. آزمون هاسمن.....
۶۰	۲-۸-۳. تخمین الگوی پانل دوطرفه با اثرات ثابت.....
۶۳	۳-۸-۳. آزمون ریشه واحد داده های پانل.....
۶۳	۱-۳-۸-۳. آزمون لوین ، لین و چو.....
۶۵	۳-۳-۸-۳. آزمون ایم و پسران شین.....

فصل چهارم

۶۷	۴- برآورد الگو و تحلیل نتایج.....
۶۷	۱-۴. مقدمه.....
۶۷	۲-۴. داده ها.....
۶۸	۳-۴. آزمون ریشه واحد.....
۷۱	۴-۴. آزمون های اثرات ثابت و یا تصادفی.....
۷۲	۵-۴. آزمون ضریب لاگرانژ توسط براش - پیگان.....
۷۳	۶-۴. آزمون هاسمن.....
۷۴	۷-۴. مدل جاذبه.....
۷۵	۸-۴. تخمین الگوی اول.....
۷۵	۱-۸-۴. معادله شماره ۱: (متغیر وابسته تجارت دو جانبه).....
۷۷	۲-۸-۴. معادله شماره ۲: (متغیر وابسته صادرات غیر نفتی).....
۷۸	۳-۸-۴. معادله شماره ۳: (متغیر وابسته صادرات نفتی).....
۷۹	۹-۴. الگوی شماره ۲.....
۷۹	۱-۹-۴. معادله شماره ۱: (متغیر وابسته تجارت دو جانبه).....
۸۰	۲-۹-۴. معادله شماره ۲: (متغیر وابسته صادرات غیر نفتی ایران).....
۸۱	۳-۹-۴. معادله شماره ۳: (متغیر وابسته صادرات نفتی ایران).....
۸۲	۱۰-۴. الگوی شماره ۳.....

فصل پنجم

۹۱	۵- نتیجه گیری و پیشنهادات.....
۹۱	۵-۱. نتیجه گیری.....
۹۳	۵-۲. پیشنهادات اقتصادی.....
۹۴	۵-۴. محدودیت ها.....
۹۴	۵-۵. پیشنهادهایی برای پژوهش های آتی.....
۹۵	منابع.....
۹۵	سایت های اینترنتی.....
۹۵	منابع فارسی.....
۹۷	منابع لاتین.....

فهرست جداول

عنوان	صفحه
۱-۴. آزمون ریشه واحد متغیر های الگوی اول:.....	۶۹
۲-۴. آزمون ریشه واحد متغیر های الگوی دوم:.....	۷۰
۳-۴. آزمون ریشه واحد متغیر های الگوی سوم:.....	۷۰
جدول ۴-۴ نتایج آزمون ضریب لاگرانژ برای تعیین اثرات ثابت در الگوی اول.....	۷۲
جدول ۵-۴ نتایج آزمون ضریب لاگرانژ برای تعیین اثرات ثابت الگوی دوم.....	۷۲
جدول ۶-۴ نتایج آزمون ضریب لاگرانژ برای تعیین اثرات ثابت در الگوی سوم.....	۷۲
جدول ۷-۴ نتایج آزمون هاسمن برای تعیین اثرات ثابت یا تصادفی در الگوی اول.....	۷۳
جدول ۸-۴ نتایج آزمون هاسمن برای تعیین اثرات ثابت یا تصادفی در الگوی دوم.....	۷۳
جدول ۹-۴ نتایج آزمون هاسمن برای تعیین اثرات ثابت یا تصادفی در الگوی سوم.....	۷۴
جدول ۱۰-۴ نتایج حاصل از تخمین معادله ۱.....	۷۵
جدول ۱۱-۴ نتایج حاصل از تخمین معادله ۲.....	۷۷
جدول ۱۲-۴ نتایج حاصل از تخمین معادله ۳.....	۷۸
جدول ۱۳-۴ نتایج حاصل از تخمین معادله ۱.....	۷۹
جدول ۱۴-۴ نتایج حاصل از تخمین معادله ۲.....	۸۰
جدول ۱۵-۴ نتایج حاصل از تخمین معادله ۳.....	۸۱
جدول ۱۶-۴ نتایج حاصل از تخمین الگوی ۳.....	۸۲

فهرست نمودارها

عنوان	صفحه
نمودار شماره (۱): اثر درآمد بر تجارت (کشور وارد کننده).....	۴۶
نمودار شماره (۲): اثر درآمد بر تجارت (کشور صادر کننده).....	۴۷
نمودار شماره (۳): اثر هزینه های مبادله بر تجارت.....	۴۸
نمودار شماره (۴): اثر ایجاد تجارت و انحراف تجارت.....	۵۰
نمودار شماره (۵): اثر ایجاد تجارت و انحراف تجارت.....	۵۱

فصل اول

مقدمه

در سالهای اخیر تحولات ساختار اقتصاد جهانی سبب وابستگی هرچه بیشتر اقتصادها و تأثیرپذیری آنها از یکدیگر گردیده است. نتایج مطالعات اخیر نشانگر کم رنگ شدن مرز میان کشورها، افزایش مبادلات بین المللی و فعالیت های مشترک و فرامنطقه ای کشورها می باشد. در واقع، انگیزه کسب منافع بیشتر، محرک گسترش و تعمیق همکاری میان کشورها است. همکاری های اقتصادی می تواند سبب افزایش مبادلات تجاری، صرفه های مقیاس، انتقال تکنولوژی و در نتیجه بهبود رفاه اقتصادی و افزایش رشد گردد. یکی از ابزارهایی که جهانی شدن اقتصاد را در سال های اخیر فعال کرده، تجارت بین الملل است که نقش حساس و اساسی را در مفهوم جهانی شدن ایفا می کند. روند افزایش تعداد اعضای سازمان تجارت جهانی در طول زمان، میتواند اهمیت برقراری تجارت آزاد و ایجاد وابستگی و همگرایی اقتصادی کشورهای جهان را به درستی آشکار کند.

براین اساس یکی از دغدغه های مهم و اساسی کشورهای در حال توسعه، آثار و پیامدهای جهانی شدن اقتصاد و افزایش شکاف بین کشورهای شمال و جنوب موضوعی بحث برانگیز در سالهای اخیر بوده است و در این رابطه مطالعات بسیاری انجام شده است. در چنین شرایطی، یکی از مهم ترین گزینه های پیش روی کشورهای در حال توسعه برای کاهش شکاف شمال - جنوب¹ و مشارکت در تقسیم کار بین المللی به منظور دستیابی به سطح توسعه و پیشرفت، تجمیع ظرفیت ها و امکانات از طریق افزایش همکاری های جنوب - جنوب² است. همچنین تجارت جنوب- جنوب می تواند موجب تسریع در رشد کشورهای جنوب شود که از نظر شاخص اقتصادی فاصله بیشتری با کشورهای پیشرو و توسعه یافته دارند. در سال های اخیر با افزایش تجارت بین کشورهای در حال توسعه (تجارت جنوب - جنوب) یک توسعه مهم در انتقال به تجارت صنعتی بین این کشورها و بالا رفتن تولیدات جهانی، همچنین کاهش موانع تجاری اتفاق افتاده است. کاهش موانع تجاری کشورهای جنوب برای کشورهای جنوب به آنها فرصت می دهد تا در ظرفیت بالای تولید جهانی شریک شوند و برای به دست آوردن فرصت های

¹ - North - South

² - South - South

³ - Office of the Chairman of the Group of 77,(2004), New York. p.10

بزرگتر و فعالیت هایی با ارزش افزوده بالاتر تشویق شوند. از طرف دیگر کشورهای در حال توسعه می توانند از طریق تجارت شمال - جنوب با استفاده از پیشرفت های تکنولوژی کشورهای توسعه یافته صنعتی امکان تقسیم بندی فرایند های تولید را به مراحل مختلف در مکان های گوناگون، بدون آسیب دیدن کارایی و سود آوری فراهم آورند. به دلیل سطح بالای تخصص، ساختار تولید، آنچنان متحول شده است که اکنون می توان قطعات گوناگون را در کشورهای مختلف و هر جا که مزیت رقابتی برای تولید آن قطعات وجود دارد، تولید کرد. بدین ترتیب، رشد فرایند تجارت و تولید جهانی شریطی را فراهم کرده است تا کشورهای مختلف بتوانند به داده های مهم تکنولوژی دسترسی پیدا نموده، از سرریز های تکنولوژی کشورهای توسعه یافته صنعتی استفاده نمایند. (اسوالدو^۱، ۲۰۰۴؛ ۲)

کشور جمهوری اسلامی ایران نیز، با تکیه بر مزایای نسبی و توانایی های مختلف اقتصادی و کسب تجارت متفاوت از همگرای یهای مختلف اقتصادی - منطقه ای می تواند توان خود را برای حرکت در روند جهانی شدن افزایش دهد.

این مطالعه، با استفاده از داده های تلفیقی طی دوره زمانی (۲۰۰۹-۲۰۰۱) و روش های متداول اقتصاد سنجی، افزون بر بررسی روش تجاری ایران به عنوان یک کشور در حال توسعه با منتخب شرکای تجاری اش در جهان، با بهره گیری از الگوی جاذبه مناسب ترین شرکای تجاری برای کل تجارت^۲ و همچنین به تفکیک صادرات نفتی و غیر نفتی مورد بررسی قرار می دهد.

در این تحقیق، نخست به معرفی مدل جاذبه، تئوری های زیر بنایی این مدل می پردازیم. این تحقیق شامل سه بخش می باشد: بخش اول شامل بررسی تجارت ایران با مهم ترین شرکای تجاری در حال توسعه این کشور می باشد به طوریکه با استفاده از مدل جاذبه تأثیر متغیرهای تولید ناخالص داخلی، جمعیت، فاصله کشورها و متغیرهای مجازی بر تجارت خارجی ارزیابی می شود.

از سوی دیگر، تأثیر متغیرهای مستقل با تفکیک صادرات به صورت صادرات نفتی و غیر نفتی ایران به عنوان متغیر های وابسته مورد بررسی قرار خواهد گرفت.

قسمت دوم این تحقیق به بررسی تجارت ایران با مهم ترین شرکای تجاری توسعه یافته این کشور اختصاص دارد به طوریکه سه معادله به صورت جداگانه با سه متغیر وابسته تجارت خارجی، صادرات نفتی و صادرات غیر نفتی بررسی می شود و با توجه به نتایج تخمین های قسمت اول و دوم تجارت ایران با کشورهای جنوب و شمال بررسی می شود.

¹ - Agatiello, Osvaldo

² - Aggregate Trade

از طرف دیگر نوسان نرخ ارز که در بر گیرنده تغییرات در برابری پول کشورهای مختلف است و می تواند اثرات متفاوتی را روی جریان های تجاری بین کشورها ایجاد کند. این تأثیرات در چارچوب مدل جاذبه تجاری قابل بررسی است.

به عبارت دیگر، اگر نرخ ارز نوسان های شدیدی را ظاهر سازد، ارزش کالاهای صادراتی و هزینه کالاهای وارداتی به پول داخلی، شدید تحت تاثیر قرار می گیرد و بنابراین هرچه عوامل تجارت خارجی کشور خطرگريزتر باشند و سهم تجارت خارجی در تولید ناخالص ملی بیشتر باشد، نوسان های نرخ ارز تاثیر بیشتری در جهت کاهش تولید داخلی، افزایش قیمت ها و تحدید تجارت خارجی خواهد داشت. بدین ترتیب در قسمت سوم با تعديل مدل جاذبه با حضور متغیر مستقل نرخ ارز واقعی، اثر این متغیر بر کل تجارت خارجی دو جانبه برای مهم ترین شرکای تجاری ایران بررسی می شود. برای مشخص کردن اثر قدرت خرید و همچنین اثر سطح قیمت های داخلی بر حجم تجارت استفاده می گردد.

۱-۱- اهمیت و ضرورت تحقیق

از آنجا که ایران کشوری در حال توسعه است و با توجه به منابع محدود و جمعیت زیاد، توجه به تجارت بین الملل و ارزیابی عوامل مؤثر بر آن امری ضروری و پر اهمیت تلقی می شود. از طرف دیگر با توجه به اهمیت نقش تولید ناخالص داخلی، جمعیت، فاصله و نرخ ارز واقعی بر تجارت خارجی، در این تحقیق به بررسی روش تجاری ایران در چارچوب مدل جاذبه می پردازیم.

یافته های تجربی نشان می دهد که رشد اقتصادی به چند عامل بستگی دارد که از میان آنها می توان به عوامل نیروی انسانی، منابع اولیه، پس انداز و سرمایه گذاری، دانش و مهارت فنی، سازماندهی و مدیریت تولید و توزیع اشاره کرد. اکثر کشورهای در حال توسعه از عواملی مانند نیروی انسانی و منابع تولید برخوردار هستند ولی از عوامل مهمی مانند دانش و مهارت فنی و سرمایه های لازم ممکن است برخوردار نباشند. برای رفع کمبود این عوامل ناچار (زیرا برای کشورهای در حال توسعه مکمل های تجارت می باشند) به برقرار کردن روابط با کشورهای دیگری هستند که از عوامل یاد شده برخوردارند. با ایجاد توافق های اقتصادی و تجاری زمینه ورود سرمایه و مهارت و دانش فنی لازم برای تولید فراهم می شود، اندازه بازارهای آنها گسترش می یابد و در نتیجه منافع حاصل از صرفه های ناشی از مقیاس افزایش می یابد.

با توجه به مفهوم تجارت جدید امروزه، تجارت بین کشورهای جهان به سه دسته تجارت بین کشورهای توسعه یافته (شمال - شمال)، کشورهای در حال توسعه (جنوب - جنوب) و کشورهای توسعه یافته و کشورهای در حال توسعه (شمال - جنوب) تقسیم بندی می شود. این همکاری ها به معنای قدرت بخشیدن به مواضع کشورهای در حال توسعه در جهت تحقق خواسته های خود است و این مستلزم ایجاد اتحاد و توسعه همکاری های اقتصادی بیشتر این کشورهاست. در سال های اخیر کشورهای در حال توسعه در کنار تجارت با کشورهای توسعه یافته برای غلبه بر روابط ناعادلانه در سیستم تجارت جهانی به سمت تجارت بیشتر با کشورهای در حال توسعه روی آوردند. به همین دلیل، همکاری بین کشورهای در حال توسعه با محور مدیریت اقتصاد منطقه ای توسعه یافته است و در همین حال ضمن جذب مشارکت شرکت های چند ملیتی، از تسلط آنها بر منابع طبیعی و فعالیت های اقتصادی کشورهای در حال توسعه ممانعت نماید. با توجه به رخدادها در تجارت جهانی این تحقیق به بررسی سمت و سوی تجارت خارجی ایران با شرکای تجاری این کشور می پردازد تا مشخص شود که آیا خصوصیات تجاری ایران و شرکای توسعه یافته بیشتر هماهنگی دارد یا شرکای در حال توسعه. و در صورتیکه به سمت کشورهای در حال توسعه رفته باشیم آیا صرفاً ملاحظات اقتصادی رعایت شده است و یا ملاحظات سیاسی نیز در توسعه تجارت مد نظر بوده است.

۱-۲- هدف تحقیق

هدف این تحقیق بررسی اثر ویژگی های شرکای تجاری بر سمت و سوی تجارت خارجی ایران با استفاده از مدل جاذبه^۱ به تفکیک کل تجارت دو جانبه، صادرات نفتی و غیر نفتی می باشد. همچنین در قالب این مدل اثرات اندازه فعالیت های اقتصادی، جمعیت، فاصله جغرافیایی، نرخ ارز واقعی و مجموعه ای از متغیرهای مجازی که شامل همسایگی، دین مشترک و عضویت در یک موافقت نامه می باشد، بر حجم تجارت ایران با سایر کشورها ارزیابی می شود.

^۱ - Gravity Model

۳-۱- سوالات تحقیق

همانگونه که در فوق ذکر شد، هدف از این مطالعه بررسی اثر ویژگی های شرکای تجاری بر تجارت خارجی ایران طی دوره ۲۰۰۹-۲۰۰۱ می باشد. براین اساس سوالات زیر مورد مطالعه قرار می گیرد:

۱. آیا اندازه فعالیت های اقتصادی با تجارت خارجی رابطه مستقیم دارد؟
۲. آیا تمایل تجاری ایران با کشورهای جنوب بیشتر از کشورهای شمال می باشد؟
۳. تا چه اندازه فاصله جغرافیایی بر تجارت دو جانبه اثر گذار است؟
۴. تا چه اندازه تجارت خارجی کشور متأثر از نوسانات نرخ ارز واقعی است؟

۴-۱- روش تحقیق

روش تحقیق کتابخانه ای است و از داده های تلفیقی که از طریق سایت های مختلف آماری تهیه شده، استفاده می شود. همچنین از نرم افزار ایویوز^۱ برای تخمین الگوی تلفیقی استفاده می شود.

^۱ - Eviews

فصل دوم