

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

به نام خدا
منشور اخلاق پژوهش

با یاری از خداوند سبحان و اعتقاد به اینکه عالم محضر خداوند است و همواره ناظر بر اعمال انسان و به منظور پاس داشت مقام بلند دانش پژوهش و نظر به اهمیت جایگاه و دانشگاه در اعتلای فرهنگ و تمدن بشری ما دانشجویان و اعضای هیات علمی واحدهای دانشگاه آزاد اسلامی متعهد می گردیم. اصول زیر را در انجام فعالیت های پژوهشی مد نظر قرار داده و از آن تخطی نکنیم:

- ۱- اصل برائت: التزام به برائت جویی از هرگونه رفتار غیر حرفه ای و اعلام موضوع نسبت به کسانی که حوزه علم و پژوهش را به شائب های غیر علمی می پالایند.
- ۲- اصل رعایت انصاف و امانت: تعهد به اجتناب از هر گونه جانب داری غیر علمی و حفاظت از اموال تجهیزات و منابع در اختیار.
- ۳- اصل ترویج: تعهد به رواج دانش و اشاعه نتایج تحقیقات و انتقال آن به همکاران علمی و دانشجویان به غیر از مواردی که منع قانونی دارد.
- ۴- اصل احترام: تعهد به رعایت حریم ها و حرمت ها در انجام تحقیقات و رعایت جانب نقد و خودداری از هرگونه حرمت شکنی.
- ۵- اصل رعایت حقوق: التزام به رعایت کامل حقوق پژوهشگران و پژوهیدگان (انسان حیوان و نبات) و سایر صاحبان حق.
- ۶- اصل راز داری: تعهد به صیانت از اسرار و اطلاعات محرمانه افراد سازمان ها و کشورها و کلیه افراد و نهادهای مرتبط با تحقیق.
- ۷- اصل حقیقت جویی: تلاش در راستای پی جویی حقیقت و وفاداری به آن و دوری از هر گونه پنهان سازی حقیقت.
- ۸- اصل مالکیت مادی و معنوی: تعهد به رعایت کامل حقوق مادی و معنوی دانشگاه و کلیه همکاران پژوهش.
- ۹- اصل منافع ملی: تعهد به رعایت مصالح ملی و در نظر داشتن پیشبرد و توسعه کشور در کلیه مراحل پژوهش.

امضاء پژوهشگر:



دانشگاه آزاد اسلامی
واحد تهران مرکزی
دانشکده اقتصاد و حسابداری

پایان نامه برای دریافت درجه کارشناسی ارشد (M.A)

رشته: اقتصاد

گرایش: علوم اقتصادی

عنوان:

بررسی اثرات نامتقارن نرخ ارز و نوسان آن بر صادرات غیرنفتی ایران

استاد راهنما:

دکتر شهریار نصایان

استاد مشاور:

دکتر ابوالفضل غیاثوند

پژوهشگر:

جهانبخش جلالی

بهار ۱۳۹۴

تقدیم بہ :

بردار شہیدم

مشکر و قدردانی:

از همسر عزیزم و فرزند مهربانم که حوصله داشتند و وقت گرانمای

خود را صرف تشویق من هدر دادند.

تعهد نامه اصالت پایان نامه کارشناسی ارشد

اینجانب جهانبخش جلالی دانش آموخته مقطع کارشناسی ارشد ناپیوسته به شماره دانشجویی ۹۱۱۰۳۱۳۴۵ در رشته علوم اقتصادی که در تاریخ ۱۳۹۴/۲/۲۰ از پایان نامه خود تحت عنوان : بررسی اثرات نامتقارن نرخ ارز و نوسان آن بر صادرات غیرنفتی ایران با کسب نمره ۱۷/۵ و درجه بسیارخوب دفاع نموده ام بدینوسیله متعهد می شوم:

۱- 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.

۲- 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.

۳- 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.

۴- 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: جهانبخش جلالی

تاریخ و امضاء ۱۳۹۴/۲/۲۳

بسمه تعالی

در تاریخ: ۱۳۹۴/۰۲/۲۰

دانشجوی کارشناسی ارشد آقای/خانم جهانبخش جلالی از پایان نامه خود دفاع نموده و با نمره ۱۷/۵ بحروف هفده ونیم و با درجه بسیارخوب مورد تصویب قرار گرفت .

امضاء استاد راهنما:

بسمه تعالی
دانشکده اقتصاد و حسابداری

(این چکیده به منظور چاپ در پژوهش نامه دانشگاه تهیه شده است)

نام واحد دانشگاهی: تهران مرکزی	کد واحد: ۱۰۱	کد شناسایی پایان نامه: ۱۰۱۲۰۹۱۵۹۳۱۰۰۴
عنوان پایان نامه: بررسی اثرات نامتقارن نرخ ارز و نوسان آن بر صادرات غیرنفتی ایران		
نام و نام خانوادگی دانشجو: جهانبخش جلالی	تاریخ شروع پایان نامه: نسیمسال اول ۹۳-۹۴	تاریخ اتمام پایان نامه: ۱۳۹۴/۲/۲۰
شماره دانشجویی: ۹۱۱۰۳۱۳۴۵		
رشته تحصیلی: علوم اقتصادی		
استاد / استادان: راهنما دکتر شهریار نصایان		
استاد/استادان مشاور: دکتر ابوالفضل غیاثوند		
<p>چکیده پایان نامه (شامل خلاصه، اهداف، روش های اجرا و نتایج به دست آمده):</p> <p>تحقیق حاضر به بررسی اثرات نرخ ارز اسمی و نوسانات نرخ ارز حقیقی بر صادرات غیر نفتی طی دوره زمانی ۱۳۵۳-۱۳۹۱ پرداخته است. در این تحقیق سعی شد به سوالات زیر پاسخ داده شود؛ ۱- آیا برای صادرکنندگان ریسک گریز، افزایش نوسانات نرخ ارز حقیقی با کاهش حجم صادرات همراه است؟ ۲- آیا می توان افزایش نرخ ارز اسمی را به عنوان یک سیاست تشویقی برای صادرات غیرنفتی مطرح کرد؟ ۳- آیا نوسانات نرخ ارز حقیقی، طی دوره های کاهش و افزایش نرخ ارز اثر متفاوتی بر صادرات غیرنفتی دارند؟ بدین منظور رگرسیون VAR و روش یوهانسن جوسیلیوس را برای متغیرهای؛ صادرات غیر نفتی، نرخ ارز اسمی، نسبت قیمت کالاهای خارجی به داخلی، تولید ناخالص داخلی حقیقی، موجودی سرمایه حقیقی و نوسانات مثبت و منفی ارز را برای دوره زمانی ۱۳۹۱-۱۳۵۳ به کار بردیم. همچنین بررسی های خود را بر اساس توابع عکس العمل تحریک انجام دادیم. نتایج این بررسی ها نشان می دهد که در بلند مدت افزایش نرخ ارز اسمی اثر منفی و بسیار کوچک بر صادرات غیر نفتی دارد، به عبارت دیگر در بلند مدت عوامل قیمتی نقش با اهمیتی در صادرات غیر نفتی ندارند و آنچه در افزایش صادرات غیر نفتی با اهمیت است عواملی مانند تولید و موجودی سرمایه می باشند. همچنین نتایج نشان می دهد، نوسانات افزایشی و کاهششی نرخ ارز اثر منفی بر صادرات غیر نفتی دارد که شدت اثر نوسانات منفی بیشتر از نوسانات افزایشی نرخ ارز می باشد.</p> <p>کلمات کلیدی: صادرات غیرنفتی، نوسانات نرخ ارز، اثرات نامتقارن، الگوی VAR، روش یوهانسن جوسیلیوس.</p>		

مناسب است

تاریخ و امضاء:

نظر استاد راهنما برای چاپ در پژوهش نامه دانشگاه

مناسب نیست

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول: تعاریف و کلیات
۱-۱	مقدمه
۲-۱	بیان مسئله
۳-۱	اهمیت موضوع تحقیق و انگیزه انتخاب آن
۴-۱	اهداف تحقیق
۵-۱	سؤالات یا فرضیه‌های تحقیق
۶-۱	روش تحقیق
۷-۱	قلمرو تحقیق
۸-۱	مروری بر مفاهیم و تعاریف
۸-۱-۱	اثرات نامتقارن
۸-۱-۲	روش خود رگرسیون برداری (مدل VAR)
۸	فصل دوم: مروری بر مبانی نظری و ادبیات تجربی
۱-۲	مقدمه
۲-۲	تحلیل ایستای کاهش ارزش پول ملی بر تراز تجاری
۱-۲-۲	روش جذب
۲-۲-۲	روش کشش‌ها
۳-۲-۲	کاهش ارزش پول و شرط مارشال لرنر معمول
۴-۲-۲	شرط مارشال لرنر تعمیم‌یافته
۵-۲-۲	اصلاح شرط مارشال لرنر در کشورهای صادرکننده نفت
۳-۲	تحلیل پویای کاهش ارزش پول ملی بر تراز تجاری
۴-۲	نوسانات نرخ ارز و صادرات غیرنفتی
۵-۲	بررسی آثار نامتقارن نوسانات نرخ ارز
۱-۵-۲	سهم بازار
۲-۵-۲	انتقال فناوری تولید
۳-۵-۲	محدودیت‌های مقداری الزام‌آور

۳۵	۲-۵-۴ هزینه‌های فهرست بها
۳۵	۲-۵-۵ رفتار پوششی نامتقارن
۳۶	۲-۶-۶ پیشینه تحقیق
۳۶	۲-۶-۱ مطالعات داخلی
۴۱	۲-۶-۲ مطالعات خارجی
۴۵	۲-۷ جمع‌بندی و نتیجه‌گیری
۴۶	فصل سوم: روش‌شناسی تحقیق و ارائه الگو
۴۷	۳-۱ مقدمه
۴۷	۳-۲ آزمون پایایی
۴۹	۳-۳ رویکرد خود رگرسیون برداری (<i>VAR</i>) و روش یوهانسن جوسیلیوس
۵۴	۳-۴ روش یوهانسن جوسیلیوس
۵۶	۳-۵ توابع عکس‌العمل تحریک در مدل <i>VAR</i> نامقید
۵۸	۳-۶ تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی در مدل <i>VAR</i> نامقید
۵۹	۳-۷ تجزیه چولسکی
۶۰	۳-۸ شاخص‌های اندازه‌گیری عدم اطمینان و ارائه مدل
۶۰	۳-۸-۱ شاخص‌های اندازه‌گیری عدم اطمینان
۶۲	۳-۸-۲ ارائه مدل
۶۵	۳-۹ شرحی بر داده‌های آماری
۶۵	۳-۹-۱ الگاریتم صادرات غیرنفتی حقیقی
۶۵	۳-۹-۲ الگاریتم نرخ ارز
۶۶	۳-۹-۳ رابطه مبادله
۶۶	۳-۹-۴ تولید ناخالص داخلی به قیمت پایه
۶۶	۳-۹-۵ متغیر مجازی جنگ
۶۷	۳-۹-۶ شوک افزایشی و کاهش‌ی نرخ ارز
۶۷	۳-۹-۷ نرخ ارز حقیقی
۶۸	۳-۱۰ خلاصه و جمع‌بندی

۶۹	فصل چهارم: برآورد و تجزیه و تحلیل مدل
۷۰	۴-۱ آمار توصیفی
۷۰	۴-۱-۱ صادرات غیر نفتی
۷۱	۴-۱-۲ صادرات غیر نفتی حقیقی
۷۲	۴-۱-۳ نرخ ارز اسمی
۷۳	۴-۱-۴ بررسی روند همزمان نرخ ارز اسمی و صادرات غیر نفتی
۷۵	۴-۱-۵ نسبت شاخص قیمت مصرف کننده آمریکا (<i>usacpi</i>) به <i>cpi</i>
۷۷	۴-۱-۶ تولید ناخالص داخلی
۷۸	۴-۱-۷ شوک افزایشی و کاهش نرخ ارز
۸۰	۴-۱-۸ موجودی سرمایه حقیقی
۸۱	۲-۴ بررسی پایایی متغیرها
۸۴	۳-۴ تعیین تعداد وقفه های بهینه و شکل الگوی تصحیح خطای برداری
۸۵	۴-۴ آزمون علیت گرنجر بلوکی
۸۶	۴-۵ آزمون رتبه ماتریس به منظور تشخیص تعداد بردارهای همجمعی
۸۸	۴-۶ تخمین مدل <i>VAR</i> نامقید
۹۱	۴-۷ رویکرد یوهانسن جوسیلیوس در تخمین مدل
۹۲	۴-۸ جمع بندی و نتیجه گیری
۹۳	فصل پنجم: نتیجه گیری و پیشنهادات
۹۴	۵-۱ خلاصه و جمع بندی
۹۷	۵-۲ توصیه ها و پیشنهادات سیاستی
۹۸	منابع و مآخذ
۱۰۳	پیوست ها

فهرست جداول

عنوان	صفحه
جدول ۱-۲: برآورد تابع صادرات کشاورزی در ایران.....	۴۰
جدول ۱-۴: نتایج آزمون دیکلی فولر برای متغیرهای مدل.....	۸۲
جدول ۲-۴: تعداد وقفه های بهینه مدل <i>VAR</i> برای معادله ۲-۳.....	۸۴
جدول ۳-۴: نتایج آزمون علیت گرنجر بلوکی برای رابطه ۲-۳.....	۸۶
جدول ۴-۴: آزمون حداکثر مقدار ویژه به منظور تعیین تعداد بردارهای همجمعی در معادله ۲-۳..	۸۷

فهرست شکل‌ها

عنوان	صفحه
شکل ۱-۲: تأثیر تغییر نرخ برابری پول بر دیگر متغیرهای اقتصادی.....	۱۴
شکل ۱-۴: آمار توصیفی صادرات غیر نفتی (میلیون دلار).....	۷۰
شکل ۲-۴: آمار توصیفی صادرات غیر نفتی حقیقی (میلیون دلار).....	۷۱
شکل ۳-۴: آمار توصیفی نرخ ارز اسمی.....	۷۲
شکل ۴-۴: نرخ ارز اسمی و صادرات غیر نفتی حقیقی.....	۷۳
شکل ۵-۴: بررسی روند شوک افزایشی و کاهش‌ی نرخ ارز حقیقی.....	۷۴
شکل ۶-۴: آمار توصیفی نسبت شاخص قیمت مصرف کننده آمریکا به ایران.....	۷۵
شکل ۷-۴: آمار توصیفی تولید ناخالص داخلی حقیقی.....	۷۷
شکل ۸-۴: روند شوک کاهش‌ی و افزایش‌ی نرخ ارز.....	۷۸
شکل ۹-۴: آمار توصیفی موجودی سرمایه.....	۸۰
شکل ۱۰-۴: نتایج آزمون دیکلی فولر برای متغیرها با یکبار تفاضلگیری.....	۸۳
شکل ۱۱-۴: مقدار تخمین زده شده لگاریتم صادرات غیر نفتی و مقدار حقیقی آن.....	۸۸
شکل ۱۲-۴: اثر یک انحراف معیار شوک نرخ ارز بر صادرات غیر نفتی در مدل <i>VAR</i>	۹۰
شکل ۱۳-۴: اثر یک انحراف معیار شوک نرخ ارز بر صادرات غیر نفتی در مدل یوهانسن جوسیلیوس.....	۹۱

فصل اول:

تعاریف و کلیات

۱-۱ مقدمه

حجم صادرات کالاهای هر کشور تا حدودی نمایانگر تولیدات، ظرفیت تولیدی و درجه توسعه اقتصادی آن کشور است. برخی از مطالعات اقتصادی و همچنین تجربه کشورهای در حال توسعه، به خصوص کشورهای آسیای جنوب شرقی نشان می‌دهند که صادرات می‌تواند به مثابه موتور و محرک رشد و توسعه اقتصادی باشد (دلار^۱، ۱۹۹۲). روش‌ها و راهبردهای مختلفی جهت توسعه صادرات غیرنفتی وجود دارد و تلاش‌های علمی و تحقیقات فراوانی در جهت تقویت و رفع کمبودها و نقصان‌های این بخش صورت گرفته است. ولی با توجه به سرعت تحولات در اقتصاد جهانی و ارزیابی عملکرد اقتصاد ایران، تجدیدنظر و دگرگونی در پاره‌ای سیاست‌ها و جهت‌گیری‌ها، ضرورتی اجتناب‌ناپذیر است. به همین منظور، این مطالعه به تحلیل اثرات متغیر نرخ حقیقی ارز بر صادرات غیرنفتی می‌پردازد. بدین منظور در این فصل ابتدا به بیان مسئله می‌پردازیم سپس اهمیت و ضرورت این تحقیق بیان می‌شود. بعد از آن اهداف، فرضیه‌ها، روش تحقیق، قلمرو تحقیق قرار گرفته است. در انتهای این فصل مروری بر مفاهیم و تعاریف آورده شده است.

۲-۱ بیان مسئله

به‌طور کلی توسعه صادرات غیرنفتی به‌عنوان یک استراتژی رشد و توسعه اقتصادی در بسیاری از کشورهای دنیا مطرح است. صادرات کالاها باعث افزایش درآمد ارزی و نیز اشتغال می‌گردد. نگاهی کوتاه به روند صادرات غیرنفتی در کشور بیانگر این واقعیت است که هرچند در برنامه‌های اول تا سوم توسعه اقتصادی وضعیت صادرات غیرنفتی ایران از رقم پیش‌بینی شده کمتر بود، اما در سال‌های برنامه چهارم، میزان صادرات غیرنفتی کشور به‌طور سرشاری افزایش یافته است (گودرزی و صبوری دیلمی، ۱۳۹۳).

^۱ (Dollar, ۱۹۹۲)

در این میان چگونگی تعیین نرخ ارز و تبیین نوسانات آن، به‌عنوان یکی از عوامل اثرگذار بر اقتصاد ملی همواره مورد توجه صاحب‌نظران و تصمیم‌گیرندگان اقتصادی در کشور بوده است. برخی از صاحب‌نظران اقتصادی بر این عقیده‌اند که افزایش نرخ ارز باعث افزایش صادرات و کاهش واردات و بهبود تراز تجاری کشور خواهد شد. این در حالی است که گروهی دیگر نرخ ارز را به‌عنوان یکی از متغیرهای کلیدی اقتصاد کشور معرفی کرده و معتقدند افزایش این نرخ، تغییر سایر متغیرهای اقتصادی همانند تورم، تولید ناخالص داخلی، صادرات و واردات را به دنبال خواهد داشت. اما در غالب موارد، نحوه تغییرات و واکنش سایر متغیرها به‌گونه‌ای است که نتایج به‌دست‌آمده درزمینه‌ی افزایش صادرات و کاهش واردات را از بین خواهد برد. گروهی دیگر معتقدند، کاهش نرخ ارز منجر به بروز مشکلات بودجه‌ای خواهد شد و ثبات نرخ ارز را مانع رشد صادرات و همچنین متضرر شدن صادرکنندگان می‌داند و در مقابل عده‌ای دیگر این ایده را مطرح می‌کنند که اولاً، هنگام تعیین نرخ ارز باید در چارچوبی فراتر از تأمین مالی بودجه فکر کرد و نرخ ارز، متغیر مناسبی برای تأمین بودجه نیست. ثانیاً، افزایش نرخ ارز چه بنا به دلایل نظری و چه بر اساس شواهد تجربی منجر به افزایش صادرات در اقتصاد ایران نخواهد شد و آثار سوء آن روی رشد و تورم، به عدم تحقق مقاصد بودجه‌ای نیز می‌انجامد (فرح‌بخش، ۱۳۹۲).

از طرفی افزایش نرخ ارز باعث نوسان نرخ ارز می‌گردد که این نوسان می‌تواند باعث کاهش صادرات گردد. ریسک نرخ ارز می‌تواند با صدمه زدن بر صادرات، موجب نوسان درآمد ارزی گردد که در این شرایط، برنامه‌ریزی‌های توسعه اقتصادی در فضایی نامطمئن صورت خواهد گرفت. سیاست‌گذاران اگر اثرات ریسک نرخ ارز را نادیده بگیرند، دخالت در بازار برای، تحریک صادرات ممکن است به شکست منتهی شود (اتیر^۱، ۱۹۷۳). بر این اساس در این تحقیق سعی بر آن است که رابطه میان صادرات غیرنفتی و نرخ ارز اسمی و نوسانات نرخ ارز حقیقی به‌طور همزمان مورد بررسی قرار گیرد. اکثر پژوهش‌های صورت گرفته در این زمینه تحت فرض تقارنی پیش رفته‌اند، یعنی این که بین اثرات ریسک، هنگام افت و ترقی نرخ ارز تفاوتی قائل نشده‌اند. درحالی که وجود اثرات نامتقارن، نا

^۱ (Ethier, ۱۹۷۳)

اطمینانی سیاست تجاری را افزایش داده و آن را پیچیده تر می کند. بنابراین، موفقیت سیاست تجاری، به فهم کامل و کنترل ریسک نرخ ارز در طول دوره های افت و ترقی بستگی دارد. شوک کاهشی، اثر بزرگ تری روی نوسانات آینده نرخ های ارز نسبت به یک شوک افزایشی به همان اندازه ایجاد می کند. چراکه صادرکنندگان ریسک گریز، زمان مواجهه با درجات متفاوت نوسانات بازار ارز خارجی، به طور یکسان رفتار نمی کنند. بنابراین، در شرایط افت و ترقی نرخ ارز ممکن است اثرات ریسک متفاوتی پدیدار گردد (تسی و تسوی^۱، ۱۹۹۷).

۳-۱ اهمیت موضوع تحقیق و انگیزه انتخاب آن

ریسک ناشی از نوسانات نرخ ارز از جمله مقولاتی است که همواره به عنوان مشکلی برای اقتصاد کشورها، خصوصاً بخش تجارت خارجی مطرح است و اهمیت این موضوع به قدری است که این ریسک بعضاً زیان های سنگین و غیرقابل جبرانی را به صادرکنندگان وارد می نماید. نرخ ارز متغیری است که بیش از سایر متغیرها با بخش خارجی اقتصاد ارتباط مستقیم و تنگاتنگ دارد. ارزش پول کشورها نه تنها تحت تأثیر سیاست های اقتصادی داخل هر کشور قرار دارد، بلکه نوسانات ارزی در بازارهای جهانی نیز بر ارزش پول و به تبع آن بر تجارت خارجی آن ها مؤثر است، نرخ ارز قیمت واردات و صادرات را تعیین می کند و نوسانات آن باعث تغییراتی در قیمت آن ها می شود و در نتیجه میزان تجارت خارجی را افزایش و یا کاهش می دهد. عدم تطابق پولی (ارزی) ریسک های سیستماتیک را در اقتصادهای در حال ظهور از طریق آسیب پذیری تراز آن ها نشان می دهد. همچنین به عنوان یک عامل کلیدی آسیب پذیر، منجر به بحران در اقتصادهای در حال ظهور گردیده است. اگرچه می تواند از طریق منابع مالی محدود شرکت های (کوچک و متوسط) و سرمایه گذاری در سبد مالی به عنوان موتور رشد اقتصادی کشورهای در حال ظهور باشد.

به عنوان یک اصل، کلیه کشورها نرخ ارز خود را به گونه ای طراحی می کنند که سبب حفظ قدرت رقابتی خارجی آنان شود و از این طریق موازنه پایداری را برای پرداخت های خارجی به دست آوردند. از طرفی یکی از دلایل عمده تضعیف قدرت رقابت خارجی در غالب کشورهای

^۱ (Tse & Tsui, ۱۹۹۷)

در حال توسعه، نرخ بالای تورم داخلی همراه با اعمال سیاست حفظ نرخ رسمی ارز است، نرخ ارز هزینه‌ها را از شکل قیمت داخلی به قیمت خارجی و یا برعکس تبدیل می‌کند با کاهش ارزش پول ملی، این عامل کاهش می‌یابد و به کاهش قیمت برای خریداران خارجی کمک می‌کند، اغلب کشورها تلاش می‌کنند تا به منظور کسب توان رقابت، هزینه‌های بالای خود را با کاهش ارزش پول ملی پوشش دهند. به بیان دیگر، سیاست کاهش ارزش پول ملی یکی از متداول‌ترین سیاست‌های ارزی است که در بیشتر کشورهای در حال توسعه برای رفع کسری تراز تجاری مورد استفاده قرار می‌گیرد. لذا با توجه به اهمیت ذکر شده در باب اثرات نرخ ارز بر میزان صادرات و واردات در این تحقیق با به کارگیری مدل خود رگرسیون برداری و روش یوهانسن جوسیلیوس به تبیین وجود رابطه بین نرخ ارز و نوسان‌های نرخ ارز بر صادرات غیرنفتی پرداخته خواهد شد.

۴-۱ هدف‌های تحقیق

هدف اصلی این تحقیق، بررسی رابطه میان نرخ ارز و نوسان آن بر صادرات غیرنفتی در اقتصاد ایران است.

۵-۱ سؤالات یا فرضیه‌های تحقیق

سؤال این تحقیق را به صورت زیر می‌توان بیان کرد:

۱. آیا برای صادرکنندگان ریسک گریز، افزایش نوسانات نرخ ارز با کاهش حجم صادرات همراه است؟

۲. آیا می‌توان افزایش نرخ ارز اسمی را به عنوان یک سیاست تشویقی برای صادرات غیرنفتی مطرح کرد؟

۳. آیا نوسانات نرخ ارز حقیقی، طی دوره‌های کاهش و افزایش نرخ ارز اثر متفاوتی بر صادرات غیرنفتی دارند؟

با توجه به سؤالات بالا و مبانی نظری، فرضیه تحقیق نیز به صورت زیر بیان می‌گردد:

۱. نوسانات نرخ ارز حقیقی، باعث کاهش صادرات می‌گردد.

۲. افزایش ارزش پول ملی (کاهش نرخ ارز) باعث افزایش صادرات می‌شود.

۳. کاهش ارزش پول ملی (افزایش نرخ ارز) باعث افزایش صادرات می‌گردد که این اثر از اثر کاهش نرخ ارز بیشتر است.

۶-۱ روش تحقیق

پژوهش حاضر از نظر هدف کاربردی و از نوع علی- پس رویدادی است. در این تحقیق از روش استقرایی استفاده می‌شود. به طوری که می‌توان نتایج حاصل از بررسی‌ها را به کل جامعه آماری تعمیم داد. به طور کلی در این تحقیق از روش علمی تحلیلی و توصیفی استفاده گردید. در این پژوهش برای جمع‌آوری اطلاعات از روش کتابخانه‌ای استفاده شده است.

۷-۱ قلمرو تحقیق

در الگوی مورد استفاده از متغیرهای زیر و برای سال‌های ۱۳۵۳ تا ۱۳۹۱ و به صورت لگاریتمی استفاده خواهد شد که در ادامه به آن‌ها اشاره می‌شود.

۱. صادرات غیرنفتی
 ۲. نرخ ارز در بازار آزاد
 ۳. رابطه مبادله
 ۴. تولید ناخالص داخلی به قیمت‌های ثابت
 ۵. نوسانات نرخ ارز
 ۶. متغیر کیفی برای دوران جنگ
- اطلاعات مورد نیاز از سایت بانک مرکزی و مرکز آمار ایران جمع‌آوری خواهد شد.

۸-۱ مروری بر مفاهیم و تعاریف

۱-۸-۱ اثرات نامتقارن

متفاوت بودن اثر نوسانات نرخ ارز بر صادرات غیرنفتی در هنگام افزایش و کاهش نرخ ارز را گویند.

۲-۸-۱ روش خود رگرسیون برداری (مدل VAR)

روش خود رگرسیون برداری یک سیستم از معادلات فرم حل شده^۱ است که در آن هر یک از متغیرهای الگو بر روی وقفه‌های گذشته خود و وقفه‌های سایر متغیرهای سیستم برازش می‌شود. سیستم معادلات فرم حل شده به راحتی به روش حداقل مربعات معمولی (OLS) به صورت کارا تخمین زده می‌شوند.

^۱ *Reduced form*