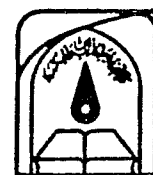


بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشگاه تربیت مدرس  
دانشکده علوم انسانی

رساله دوره دکتری علوم اقتصادی

# سیاست‌های ارزی و تجاری و تأثیر آن بر تحولات بخش صنعت در ایران (۷۷-۱۳۴۲)

۱۳۸۱ / ۱۱ / ۲۰

عبدالمجید آهنگری

استاد راهنما:

دکتر حسین عظیمی

اساتید مشاور:

دکتر کاظم یآوری    دکتر سید عزیز آرمن

دی ماه ۱۳۸۰

ع ۰۲۱۷

کتابخانه تخصصی اقتصاد ایران  
شماره ثبت کتاب: ۴۰۲۱۷


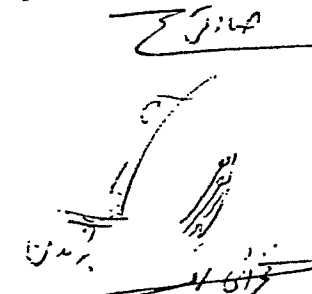




016793

تاییدیه اعضای هیئت داوران حاضر در جلسه دفاع از رساله دکتری

اعضاء هیئت داوران نسخه نهایی رساله خانم/ آقای عبدالمجید آهنگری

تحت عنوان سیاست های ارزی و تجاری و تاثیر آن بر تحولات بخش صنعت در ایران (۷۷-۱۳۴۲)

را از نظر قلم و محتوی بررسی نموده و پذیرش آنرا برای تکمیل درجه دکتری پیشنهاد می کنند.

اعضا هیئت داوران	نام و نام خانوادگی	رتبه علمی	امضاء
۱- استاد راهنما	حسین عظیمی	دانشیار	
۲- استاد مشاور	کاظم یاوری	استادیار	
۳- استاد مشاور	سیدعزیز آرمن	استادیار	
۴- استاد ناظر	حسین صادقی	استادیار	
۵- استاد ناظر	جمشید پژوهان	استاد	
۶- استاد ناظر	سید مرتضی افقه	استادیار	
۷- استاد ناظر	عنایت افخرایی	دانشیار	
۸- نماینده شورای تحصیلات تکمیلی	کاظم یاوری	استادیار	

## آیین نامه چاپ پایان نامه (رساله) های دانشجویان دانشگاه تربیت مدرس

نظر به اینکه چاپ و انتشار پایان نامه (رساله) های تحصیلی دانشجویان دانشگاه تربیت مدرس مبین بخشی از فعالیتهای علمی - پژوهشی دانشگاه است بنابراین به منظور آگاهی و رعایت حقوق دانشگاه، دانش آموختگان این دانشگاه نسبت به رعایت موارد ذیل متعهد می شوند:

ماده ۱: در صورت اقدام به چاپ پایان نامه (رساله) ی خود، مراتب را قبلاً به خور کتبی به مرکز نشر دانشگاه اطلاع دهد

ماده ۲: در صفحه سوم کتاب (پس از برگ شناسنامه)، عبارت ذیل را چاپ کند:

«کتاب حاضر، حاصل پایان نامه کارشناسی ارشد / رساله دکتری نگارنده در رشته اقتصاد است که

در سال ۱۳۸۰ در دانشکده علوم انسانی دانشگاه تربیت مدرس به راهنمایی سرکار خانم/جناب

آقای دکتر حسین عظیمی و مشاوره سرکار خانم/ جناب آقای دکتر کاظم یاوری و دکتر سید عزیز آرمن از

آن دفاع شده است.»

ماده ۳: به منظور جبران بخشی از هزینه های نشریات دانشگاه تعداد یک درصد شمارگان کتاب (در هر نوبت چاپ) را به

مرکز نشر دانشگاه اهدا کند دانشگاه می تواند مازاد نیاز خود را به نفع مرکز نشر در معرض فروش قرار دهد.

ماده ۴: در صورت عدم رعایت ماده ۳، ۵۰٪ بهای شمارگان چاپ شده را به عنوان خسارت به دانشگاه تربیت مدرس، تأدیه

کند

ماده ۵: دانشجوی تعهد و قبول می کند در صورت خودداری از پرداخت بهای خسارت، دانشگاه می تواند خسارت مذکور را از

ضریق مراجع قضایی مطالبه و وصل کند؛ به علاوه به دانشگاه حق می دهد به منظور استیفای حقوق خود، از طریق دادگاه،

معادل وجه مذکور در ماده ۴ را از محل توقیف کتابهای عرضه شده نگارنده برای فروش، تأمین نماید

ماده ۶: اینجناب عبدالمجید آهنگری دانشجوی رشته اقتصاد مقطع دکتری تعهد فوق

و ضمانت اجرایی آن را قبول کرده، به آن ملتزم می شوم.

(شماره شماره (۲) کارشناسی و دکتری)

عبدالمجید آهنگری

۸۱۰۱

مرکز نشر دانشگاه تربیت مدرس

تقديم به:

همسرفداكار و فرزندان عزيزم

## تقدیر و تشکر

اکنون که در سایه الطاف الهی، تحقیق حاضر به پایان رسیده است، بر خود لازم می‌دانم از جناب آقای دکتر عظیمی که با کمال حوصله و محبت، راهنمایی این رساله را به عهده داشتند، از صمیم قلب، تشکر و قدردانی نمایم. همچنین از مشاوران محترم، جناب آقای دکتر یآوری و جناب آقای دکتر آرمن و اعضاء محترم داوران سپاسگزاری می‌نمایم.

از سایر همکاران خصوصاً جناب آقای فراز مند و جناب آقای خاکسار و خانم مرادی و دیگر افرادی که اینجانب را یاری نمودند و در این مجال کوتاه امکان نام‌بردن از همه آنها نیست، کمال امتنان را دارم.

در پایان از همسر فداکارم، بنخاطر همفکری، زحمات بی‌دریغ و تحمل سختی‌های دوران تحصیل و نگارش رساله، سپاسگزارم.

## چکیده

تحولات بخش صنعت در جریان توسعه اقتصادی کشورها، از اهمیت خاصی برخوردار است. در این رابطه یکی از موضوعات اساسی، نقش سیاست‌های ارزی و تجاری در این تحولات است. این تحقیق، تاثیر سیاست‌های مذکور بر بخش صنعت در ایران را برای دوره ۷۷-۱۳۴۲، از کانال نرخ موثر ارز به مفهوم نرخ رسمی ارز، تعدیل شده بوسیله عناصر سیاست‌های بازرگانی خارجی (مانند تعرفه واردات و یا رانه صادرات) ارزیابی کرده است. برای این منظور مفاهیم نرخ موثر ارز واردات (EERM)، نرخ موثر ارز صادرات (EERX) و شاخص تبعیض تجاری ( $\frac{EERM}{EERX}$ )، بکار گرفته شده است.

$$EERM = E_m (1 + T_m - S_m) \quad EERX = E_x (1 + S_x - T_m)$$

$E_m$  و  $E_x$  نرخ رسمی ارز واردات و صادرات و  $T_m$ ,  $T_x$ ,  $S_m$ ,  $S_x$  بترتیب معرف نرخ مالیات و نرخ یارانه واردات و صادرات می‌باشد.

در این مطالعه، پس از اندازه‌گیری نرخ‌های موثر ارز و شاخص‌های تبعیض تجاری، چگونگی رابطه متغیرهای مذکور با ارزش افزوده صنعت و صادرات کالاهای صنعتی، با استفاده از روش اقتصادسنجی Ols برآورد گردیده است و برای اطمینان از کاذب نبودن نتایج نیز از روش انگل - گرنجر استفاده شده است. اندازه شاخص تبعیض تجاری، نشان می‌دهد که سیاست‌های دولت در زمینه تعیین نرخ رسمی ارز و عناصر سیاستی بازرگانی خارجی در سالهای ۵۲-۱۳۴۲ و ۵۷-۱۳۵۳ بترتیب در جهت جایگزینی واردات ( $\frac{EERM}{EERX} > 1$ ) و تشویق صادرات ( $\frac{EERM}{EERX} < 1$ ) بوده است.

در سالهای پس از انقلاب تا ۱۳۷۷، بجز ۶۰-۱۳۵۸، در سایر سالها، اندازه شاخص مذکور، بیانگر جهت‌گیری منفی صادرات است.

در قسمت دیگر تحقیق، نتایج حاصله از بکارگیری روشهای اقتصادسنجی، بیانگر تاثیر انقباضی افزایش نرخ موثر ارز واردات بر ارزش افزوده صنعت است که با توجه به وابستگی بخش صنعت به واردات عوامل تولید، قابل توجیه می‌باشد. این مسئله ایجاب می‌کند جهت‌گیری کلی دولت در سیاستهای اقتصادی در راستای کاهش وابستگی بخش صنعت و در واقع تغییر ساختار صنعت کشور در جهت افزایش سهم صنایع واسطه‌ای و سرمایه‌ای در نتیجه افزایش سهم این کالاها در تولید کالاهای صنعتی باشد. برای این منظور، یکی از اقدامات اساسی، جلوگیری از

تبعیض تجاری بنفع تولید کالاهای مصرفی نسبت به کالاهای واسطه‌ای و سرمایه‌ای است. بالاتر بودن نرخ‌های تعرفه واردات کالاهای مصرفی نسبت به واردات عوامل تولید که موجب فزونی نرخ موثر ارز واردات کالاهای مصرفی نسبت به کالاهای واسطه‌ای و سرمایه‌ای می‌شود عملاً تبعیض را بنفع تولید کالاهای مصرفی شکل می‌دهد. لذا کاهش اختلاف مذکور در راستای کاهش این تبعیض خواهد بود. البته، افزایش تعرفه واردات عوامل تولید به منظور فوق، با توجه به وابستگی بالای بخش صنعت و جلوگیری از افزایش رکود، می‌تواند بصورت تدریجی و همراه با اصلاح ساختاری در این بخش انجام شود. رابطه مثبت و معنی دار EERX با صادرات کالاهای صنعتی از نتایج دیگر این بخش از تحقیق است. طبق نتیجه حاصله، افزایش ۱ درصد در EERX، با فرض ثبات سایر عوامل، موجب رشد صادرات صنعتی کشور به میزان ۱/۶ درصد می‌گردد. در این رابطه کرونگر (۱۹۷۸) براساس تحقیقات بعمل آمده در گروهی از کشورهای در حال توسعه، نشان داده است، افزایش نرخ موثر ارز، از طریق عناصر غیر ارزی، موجب نااطمینانی کمتری نسبت به افزایش آن از طریق نرخ رسمی ارز می‌شود و در نتیجه امکان موفقیت را در سیاست مذکور افزایش می‌دهد. در ضمن براساس ملاحظات آماری در این مطالعه، بنظر می‌آید افزایش EERX، هرگاه همراه با کاهش و یا حذف پیمان ارزی و نیز ارائه مجوز واردات در مقابل صادرات باشد، تاثیر بیشتری بر رشد صادرات صنعتی دارد. در این ارتباط، با توجه به تجربه‌های گذشته، در شرایط امکان خروج گسترده ارز از کشور، می‌توان بجای کاهش و یا حذف پیمان ارزی، از ارائه مجوز واردات در مقابل صادرات استفاده کرد. یکی دیگر از متغیرهای مورد نظر یعنی شاخص تبعیض تجاری با صادرات صنعتی، دارای رابطه مثبت و معنی دار گردیده که با مبانی تئوریک سازگاری ندارد. این ناسازگاری می‌تواند بدلیل ویژگیهای ساختاری بخش صنعت مانند دولتی بودن بخش قابل توجهی از صنایع کشور و یا وابستگی شدید صنایع به درآمدهای نفتی باشد.

کلمات کلیدی:

سیاستهای ارزی و تجاری	بخش صنعت	ایران	نرخ موثر ارز واردات
نرخ موثر ارز صادرات	شاخص تبعیض تجاری		جایگزینی واردات
تشویق صادرات	اقتصاد سنجی		صادرات کالاهای صنعتی



عنوان	صفحه
مقدمه.....	۱
<b>فصل اول مبانی تئوریک.....</b>	<b>۶</b>
۱-۱- مقدمه.....	۷
۲-۱ مفاهیم.....	۷
۱-۲-۱- نرخ اسمی ارز.....	۷
۲-۲-۱- نرخ رسمی ارز.....	۸
۳-۲-۱- نرخ واقعی ارز.....	۸
۴-۲-۱- پیمان ارزی.....	۱۰
۵-۲-۱- مالیات بر واردات.....	۱۰
۶-۲-۱- بخش صنعت در ایران.....	۱۱
۳-۱- نرخ موثر ارز و تخمین آن.....	۱۲
۱-۳-۱- تعریف نرخ موثر ارز (EER).....	۱۳
۱-۱-۳-۱- نرخ موثر ارز واردات.....	۱۳
۲-۱-۳-۱- نرخ موثر ارز صادرات.....	۱۳
۲-۳-۱- تخمین نرخ موثر ارز.....	۱۴
۴-۱- کاهش ارزش پول و سیاست‌های جایگزین.....	۱۷
۱-۴-۱- تعرفه واردات و یازانه صادرات.....	۱۷
۲-۴-۱- نرخ‌های ارز چندگانه.....	۱۹

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱۹	۱-۴-۳- برنامه تثبیت
۲۰	۱-۴-۴- سیاست درآمدی
۲۶	۱-۵- تبعیت تجاری و شاخص نرخ موثر ارز نسبی (EERM/EERX).....
۲۶	۱-۵-۱- مروری بر راهبردهای تجاری
۲۷	۱-۵-۲- شاخص تبعیت تجاری
۲۷	۱-۵-۲-۱- شاخص کرونگر
۲۸	۱-۵-۲-۲- شاخص کاوسی
۲۸	۱-۵-۲-۳- شاخص نرخ موثر ارز نسبی
۳۳	۱-۶- نرخ موثر ارز و تولید
۳۸	۱-۷- نرخ موثر ارز و صادرات
۴۵	۱-۸- خلاصه و نتایج فصل اول
<b>فصل دوم: مروری بر مطالعات گذشته</b>	
۴۹	۲-۱- مقدمه
۴۹	۲-۲- مطالعات خارجی
۵۷	۲-۳- مطالعات داخلی
۶۵	۲-۴- خلاصه و نتیجه گیری فصل دوم

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
	فصل سوم: سیاست‌های ارزی و تجاری در ایران ۷۷-۱۳۴۲
	(با تاکید بر بخش صنعت)
۶۸	۱-۳- مقدمه
	۲-۳- سیاست‌های ارزی و تجاری در زمینه واردات
۶۸	۱-۲-۳- مقطع ۱۳۴۲-۵۲
۶۹	۲-۲-۳- مقطع ۱۳۵۳-۵۷
۷۰	۳-۲-۳- مقطع ۱۳۵۸-۶۷
۷۱	۴-۲-۳- مقطع ۱۳۶۸-۷۷
۷۳	۵-۲-۳- نرخ موثر ارز برای واردات
۷۷	۶-۲-۳- تغییرات EERM
۸۰	۳-۳- سیاست‌های ارزی و تجاری در زمینه صادرات (کالاهای صنعتی)
۸۰	۱-۳-۳- مقطع ۱۳۴۲-۵۲
۸۲	۲-۳-۳- مقطع ۱۳۵۳-۵۷
۸۲	۳-۳-۳- مقطع ۱۳۵۸-۶۷
۸۳	۴-۳-۳- مقطع ۱۳۶۸-۷۷
۸۴	۵-۳-۳- نرخ موثر ارز برای صادرات
۸۶	۶-۳-۳- تغییرات EERX
۹۰	۴-۳- تبعیض تجاری
۹۶	۵-۳- خلاصه و نتیجه‌گیری فصل سوم
۹۷	ضمیمه فصل سوم

صفحه	عنوان
	فصل چهارم: تحولات بخش صنعت در ایران ۱۳۷۷-۱۳۴۲ (با تاکید بر سیاست‌های ارزی و تجاری)
۱۰۴	۱-۴- مقدمه
۱۰۴	۲-۴- ارزش افزوده بخش صنعت
۱۰۴	۱-۲-۴- مقطع ۱۳۴۲-۵۲
۱۰۶	۲-۲-۴- مقطع ۱۳۵۳-۵۷
۱۰۹	۳-۲-۴- مقطع ۱۳۵۸-۶۷
۱۱۱	۴-۲-۴- مقطع ۱۳۶۸-۷۷
۱۱۵	۳-۴- صادرات کالاهای صنعتی
۱۱۵	۱-۳-۴- مقطع ۱۳۴۲-۵۲
۱۱۶	۲-۳-۴- مقطع ۱۳۵۳-۵۷
۱۱۸	۳-۳-۴- مقطع ۱۳۵۸-۶۷
۱۱۹	۴-۳-۴- مقطع ۱۳۶۸-۷۷
۱۲۴	۴-۴- خلاصه و نتیجه‌گیری فصل چهارم

فصل پنجم: آزمون کمی تاثیر تغییرات نرخ موثر ارز بر ارزش افزوده بخش صنعت و صادرات

کالاهای صنعتی

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱۲۷	۱-۵- مقدمه
۱۲۸	۲-۵- مدل ارزش افزوده صنعت
۱۲۸	۱-۲-۵- ارائه مدل
۱۳۰	۲-۲-۵- تخمین مدل
۱۳۳	۳-۲-۵- تحلیل نتایج
۱۳۴	۳-۵- مدل صادرات کالاهای صنعتی
۱۳۴	۱-۳-۵- ارائه مدل
۱۳۶	۲-۳-۵- تخمین مدل
۱۳۷	۳-۳-۵- تحلیل نتایج
۱۴۲	۴-۵- خلاصه و نتیجه گیری فصل پنجم

فصل ششم: تلخیص، نتیجه گیری و پیشنهادات

۱۴۵	۱-۶- تلخیص و نتیجه گیری
۱۵۲	۲-۶- پیشنهادات

صفحه	عنوان
۱۵۶	منابع
۱۶۶	خروجیهای کامپیوتری
۱۸۳	چکیده انگلیسی

## فهرست جداول

صفحه	عنوان
۲۴	جدول شماره ۱ = نرخ‌های ارز (اسمی و موثر)، کاهش ناخالص و خالص ارزش پول برای ده کشور در حال توسعه
۲۵	جدول شماره ۲ = کاهش خالص ارزش پول و رفتار نرخ‌های واقعی ارز در ده کشور در حال توسعه
۵۵	جدول شماره ۳ = برابری قدرت خرید: نرخ‌های موثر ارز (دلار/روپیه) برای هند (۱۹۵۰-۱۹۸۶)
۷۵-۷۶	جدول شماره ۴ = نرخ مالیات بر واردات (درصد) و نرخ موثر ارز برای واردات
۷۹	جدول شماره ۵ = تغییرات سالانه EERM
۸۸	جدول شماره ۶ = نرخ موثر ارز صادرات صنعتی و تغییرات آن (۷۷-۱۳۴۲)
۹۱	جدول شماره ۷ = جدول تغییرات نرخ رسمی ارز (۷۷-۱۳۴۲)
۹۳	جدول شماره ۸ = شاخص تبعیض تجاری (۷۷-۱۳۴۲)
۹۵	جدول شماره ۹ = نرخ موثر ارز (واحد پول داخلی به ازای هر دلار آمریکا در کشورهای در حال توسعه)
۹۸	جدول شماره ۱۰ = سود بازرگانی و عوارض گمرکی استردادی به صادرکنندگان کالاهای صنعتی (به ازاء هر دلار صادرات)
۱۰۰	جدول شماره ۱۱ = حق ثبت سفارش استردادی به صادرکنندگان کالاهای صنعتی (به ازاء یک دلار صادرات بطور متوسط)
۱۲۹	جدول شماره ۱۲ = آزمون ریشه واحد
۱۳۵	جدول شماره ۱۳ = آزمون ریشه واحد

فهرست نمودارها

صفحه	عنوان
۳۱	نمودار شماره ۱ = جایگزینی واردات، تشویق صادرات در یک مدل دو بخشی ...
۴۱	نمودار شماره ۲ = تعرفه‌ها و قیمت‌های نسبی .....
۷۴	نمودار شماره ۳ = نرخ مالیات بر واردات (در صد) .....
۷۸	نمودار شماره ۴ = نرخ موثر ارز برای واردات (۷۷-۱۳۴۲) .....
۸۹	نمودار شماره ۵ = نرخ موثر ارز برای صادرات کالاهای صنعتی (۷۷-۱۳۴۲) .....
۹۴	نمودار شماره ۶ = شاخص تبعیض تجاری ( $\frac{EERM}{EERX}$ ) ۷۷-۱۳۴۲ .....
۱۰۸	نمودار شماره ۷ = ارزش افزوده بخش صنعت (۷۷-۱۳۴۲) .....
۱۱۰	نمودار شماره ۸ = سرمایه گذاری بخش خصوصی و سرمایه گذاری کل در ماشین آلات (۷۷-۱۳۴۲) .....
۱۱۲	نمودار شماره ۹ = نرخ موثر اسمی ارز واردات (EERM) و نرخ واقعی موثر ارز واردات (REERM) (۷۷-۱۳۴۲) .....
۱۱۷	نمودار شماره ۱۰ = صادرات کالاهای صنعتی (XI) ۷۷-۱۳۴۲ .....
۱۲۱	نمودار شماره ۱۱ = نرخ آزاد ارز (FER)، نرخ موثر ارز صادرات (EERX) (۷۷-۱۳۴۲) .....
۱۲۲	نمودار شماره ۱۲ = نرخ موثر ارز برای صادرات (اسمی، EERX و واقعی، REERX) - (۷۷-۱۳۴۲) .....
۱۳۲	نمودار شماره ۱۳ = برآزش تابع ارزش افزوده بخش صنعت .....
۱۳۸	نمودار شماره ۱۴ = برآزش تابع صادرات کالاهای صنعتی .....