





دانشگاه بلوچستان

تحصیلات تکمیلی

پایان نامه کارشناسی ارشد در رشته اقتصاد (گرایش علوم اقتصادی)

عنوان:

تأثیر نوسانات نرخ ارز واقعی بر واردات کالاهای واسطه‌ای ایران (۸۹-۱۳۳۸)

استاد راهنما:

دکتر نظر دهمرده

استاد مشاور:

دکتر غلامرضا زمانیان

تحقیق و نگارش:


امیر خلیفه‌قلی

شهریور ۱۳۹۱


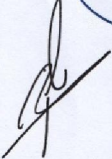


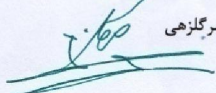
بسمه تعالی

این پایان نامه با عنوان " تأثیر نوسانات نرخ ارز واقعی بر واردات کالاهای واسطه‌ای ایران (۸۹-۱۳۳۸)" قسمتی از برنامه آموزشی دوره کارشناسی ارشد در رشته علوم اقتصادی توسط دانشجو امیر خلیفه‌قلی با راهنمایی استاد پایان‌نامه دکتر نظر دهمرده تهیه شده است. استفاده از مطالب آن به منظور اهداف آموزشی با ذکر مرجع و اطلاع کتبی به حوزه تحصیلات تکمیلی دانشگاه سیستان و بلوچستان مجاز می‌باشد.

امیر خلیفه‌قلی

امضاء


این پایان‌نامه ۶ واحد درسی شناخته می‌شود و در تاریخ ۹۱/۶/۳۱ توسط هیئت داوران بررسی و درجه بسیارخوب به آن تعلق گرفت.

نام و نام خانوادگی	امضاء	تاریخ
استاد راهنما: دکتر نظر دهمرده		
استاد مشاور: دکتر غلامرضا زمانیان		
داور ۱: دکتر محمد نبی شهیکی تاش		
داور ۲: دکتر حبیب استغایی		
نماینده تحصیلات تکمیلی: جناب آقای احمد رضا سرگلزهی		



تعهدنامه اصالت اثر

اینجانب امیر خلیفه‌قلی تعهد می‌کنم که مطالب مندرج در این پایان‌نامه حاصل کار پژوهشی اینجانب است و به دستاوردهای پژوهشی دیگران که در این نوشته از آن استفاده شده است مطابق مقررات ارجاع گردیده است. این پایان‌نامه پیش از این برای احراز هیچ مدرک هم‌سطح یا بالاتر ارائه نشده است.

کلیه حقوق مادی و معنوی این اثر متعلق به دانشگاه سیستان و بلوچستان می‌باشد.

امیر خلیفه‌قلی

امضاء

تقدیم بہ

روان پاک مادرم کہ با مہربانی ہای بی کران خود آرام جانم بود،

پدرم کہ با ایثار ہای بی دریغ خود الگوی مردانگی زندگانیم است،

برادرانم کہ با حمایت ہای صمیمانہ خود پشوانہ روزہای سخت اند،

خواہرم کہ وجودش امید بخش روزہای روشن است،

و تمام دوستان با وفایم۔

پاسکزاری

حد و ستایش محض ذات پروردگار است که میچکس را توان پاس دیای بی نیایت الطافش نیست. پاس پروردگار را که به ما عقل ارزانی کرد و از طریق آن به ما علم آموخت. دانایی که فراموش نکند هر که را که یادش کند و کم نکند نعمتش را از کسی که پاسکزاری کند.

بر خود می دانم از زحمات استاد راهنمای ارجمند جناب آقای دکتر دهمرده و استاد مشاور محترم جناب آقای دکتر زمانیان کمال تشکر و قدردانی را به جای آورم که با پشتیبانی علمی خود مراد طول تحقیق یاری نمودند.

همچنین از دوستانم آقایان رضا خانی، حامد خدیوی، کامران برقدان، محمود پاداش، عبدالشکور یکی تمدانی، بهنام جبرایی، ایوب ابوزدی، مهدی جعفری، حیدر نارویی، مهدی محسنی تبار، هادی کریم و مصطفی شمس الدینی و خانم هانم باصبا ثابت مهر، همسایه قدرتمند، سمیرا زیدی زاده، خدیجه دینارزی و سمانه نوری نهایت سپاس را دارم که با وفاداری، معرفت و کمک های خود موجب صفای دوران تحصیل و پیشرفت این تحقیق شدند.

و سایر عزیزانی که گرچه مجالی برای معرفی آنها نیست اما جای ایشان را ارج می نهم.

چکیده

کشورهای در حال توسعه، از جمله ایران با توجه به نواقص ساختاری و کمبود و عدم کارایی نهاده‌های تولید، همواره نیاز به واردات کالاها به خصوص کالاهای واسطه‌ای دارند؛ چرا که نقش بسزایی در ایجاد فرصت‌ها، توسعه زیرساخت‌ها و تقویت بخش تولید ایفا می‌نماید. همچنین نرخ ارز اصلی‌ترین متغیر مؤثر بر تراز پرداخت‌ها است که علاوه بر تأثیر بر بخش خارجی کشور می‌تواند بر چالش‌های بخش داخلی نیز مؤثر باشد.

در این مطالعه به بررسی اثر نوسانات نرخ ارز واقعی بر واردات واسطه‌ای ایران طی دوره ۸۹-۱۳۳۸ پرداخته شده است. در ابتدا با استفاده از داده‌های سالیانه، نرخ ارز واقعی محاسبه شده و رفتار واردات واسطه‌ای با بکارگیری الگوی *VECM* مورد ارزیابی قرار گرفته است. نتایج نشان داد در بلندمدت بین تقاضای واردات واسطه‌ای ایران و متغیرهای اصلی آن رابطه تعادلی وجود دارد؛ بطوریکه مطابق با تئوری با ارزش افزوده صنعت، رابطه مستقیم و با قیمت نسبی واردات و نرخ ارز واقعی، رابطه معکوس دارد. نتایج تابع واکنش آنی بیان کرد که پس از ۷ سال اثر شوک وارده از سمت نرخ ارز واقعی مضمحل شده و واردات واسطه‌ای در ۸٪ پایین‌تر از سطح تعادل اولیه پایدار می‌شود. همچنین نتایج تجزیه واریانس گویای آن است که قیمت نسبی واردات بیشترین اهمیت نسبی را در توضیح-دهندگی واردات دارد. بنابراین باید گفت نوسانات نرخ ارز واقعی با ایجاد فضای نامطمئن و بی‌ثباتی در روند قیمت-های نسبی، از طریق افزایش هزینه کالاهای واسطه‌ای وارداتی موجب افزایش هزینه‌های تولید (کاهش تولید)، افزایش سطح عمومی قیمت‌ها و کاهش سرمایه‌گذاری خصوصی شده است.

برای رفع مشکلات پولی اقتصاد ایران از جمله تورم و کمبود تولید و جهت حفظ تعادل داخلی و خارجی همراه با رشد اقتصادی، هماهنگی بین سیاست‌های پولی، مالی و ارزی و توجه به تأثیر نرخ ارز روی اقتصاد داخلی ضروری است. تلاش برای کاهش نوسانات نرخ تورم، وسعت بخشیدن به بازارهای مالی، مدیریت درآمدهای نفتی و کنترل صندوق ذخیره ارزی می‌تواند راهکارهای مناسبی جهت ثبات بخشیدن به بازار ارز باشد تا بتوان انگیزه‌های سرمایه-گذاری خصوصی را تقویت نمود. همچنین ایجاد زیربناهای اقتصادی، تعرفه‌ها و اهرم‌های قانونی، افزایش بهره‌وری و کارایی نیروی کار از طریق آموزش به همراه فرهنگ‌سازی و جهت‌دهی الگوی مصرف به سمت تولیدات داخل می-تواند به کنترل واردات واسطه‌ای (و نهایتاً کاهش وابستگی وارداتی)، حمایت از تولید داخلی، افزایش اشتغال، ثبات قیمت‌های داخلی و افزایش رفاه جامعه بینجامد.

کلمات کلیدی: ایران، تابع واکنش آنی، تجزیه واریانس، کالای واسطه‌ای، نرخ ارز واقعی، واردات، *VECM*.

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول: کلیات تحقیق
۲	۱-۱- مقدمه
۳	۲-۱- بیان مسئله و سؤالات اصلی تحقیق
۵	۳-۱- ضرورت انجام تحقیق
۶	۴-۱- فرضیات تحقیق
۶	۵-۱- اهداف تحقیق
۷	۶-۱- کاربردهای تحقیق
۷	۷-۱- استفاده کنندگان از نتایج تحقیق
۸	۸-۱- نوآوری تحقیق
۸	۹-۱- روش انجام تحقیق
۹	۱۰-۱- روش جمع‌آوری اطلاعات و محدوده تحقیق
۹	۱۱-۱- محدودیت‌های تحقیق
۱۰	۱۲-۱- ساختار تحقیق
۱۱	فصل دوم: ادبیات تحقیق
۱۲	۱-۲- مقدمه
۱۲	۲-۲- اهمیت تجارت بین‌الملل و نقش آن در رشد و توسعه اقتصادی
۱۴	۳-۲- ترازپرداخت‌ها و اجزای آن
۱۵	۴-۲- حساب جاری و اجزای آن
۱۷	۵-۲- انواع واردات و تابع تقاضای واردات واسطه‌ای
۱۹	۶-۲- مفهوم نرخ ارز
۲۰	۷-۲- نرخ ارز اسمی و نرخ ارز واقعی
۲۱	۸-۲- روش‌های اندازه‌گیری نرخ ارز واقعی
۲۱	۱-۸-۲- نسبت قیمت کالاهای تجاری به غیرتجاری
۲۲	۹-۲- نرخ ارز واقعی تعادلی
۲۳	۱۰-۲- انحراف نرخ ارز واقعی از مسیر تعادلی و مشکلات ناشی از آن
۲۶	۱۱-۲- رابطه نرخ ارز و واردات
۲۸	۱۲-۲- گذر نرخ ارز

۲۹ تأثیر نامتقارن نوسانات نرخ ارز بر عرضه و تقاضای کل
۳۱ ۱۴-۲- روند واردات و واردات واسطه‌ای در ایران
۳۱ ۱-۱۴-۲- قبل از انقلاب اسلامی (۱۳۳۸-۵۷)
۳۲ ۲-۱۴-۲- پس از پیروزی انقلاب اسلامی (۱۳۵۸-۸۹)
۳۵ ۱۵-۲- روند تحولات ارزی در ایران
۳۵ ۱-۱۵-۲- قبل از انقلاب اسلامی (۱۳۳۶-۵۷)
۳۶ ۲-۱۵-۲- پس از پیروزی انقلاب اسلامی (۱۳۵۸-۸۹)
۴۳ ۱۶-۲- خلاصه و نتیجه‌گیری
۴۵ فصل سوم: پیشینه تحقیق
۴۶ ۱-۳- مقدمه
۴۶ ۲-۳- مطالعات داخلی
۴۶ ۱-۲-۳- مطالعه توفیقی و محرابیان (۱۳۸۱)
۴۷ ۲-۲-۳- مطالعه مزینی و یآوری (۱۳۸۴)
۴۸ ۳-۲-۳- مطالعه شجری و همکاران (۱۳۸۴)
۴۸ ۴-۲-۳- مطالعه تشکینی و باستانی (۱۳۸۵)
۴۹ ۵-۲-۳- مطالعه حسینی و همکاران (۱۳۸۶)
۴۹ ۶-۲-۳- مطالعه جلال‌آبادی و همکاران (۱۳۸۶)
۵۰ ۷-۲-۳- مطالعه موسوی‌محسنی و سبحانی‌پور (۱۳۸۷)
۵۰ ۸-۲-۳- مطالعه رستمی و احمدلو (۱۳۸۹)
۵۱ ۹-۲-۳- مطالعه سپانلو و قنبری (۱۳۸۹)
۵۱ ۱۰-۲-۳- مطالعه قنبری و همکاران (۱۳۸۹)
۵۲ ۳-۳- مطالعات خارجی
۵۲ ۱-۳-۳- مطالعه آریز (۱۹۹۸)
۵۳ ۲-۳-۳- مطالعه ساساکی (۲۰۰۲)
۵۴ ۳-۳-۳- مطالعه برحومی (۲۰۰۵)
۵۵ ۴-۳-۳- مطالعه کیپتا و همکاران (۲۰۰۵)
۵۵ ۵-۳-۳- مطالعه ممتاز و همکاران (۲۰۰۶)
۵۶ ۶-۳-۳- مطالعه کندیل و برمنت (۲۰۰۸)
۵۷ ۷-۳-۳- مطالعه دواسا (۲۰۰۹)

۵۷ ۸-۳-۳- مطالعه نسیم و همکاران (۲۰۰۹)
۵۸ ۹-۳-۳- مطالعه شی و ژو (۲۰۱۰)
۶۰ فصل چهارم: روش‌شناسی، تصریح و برآورد مدل
۶۱ ۱-۴- مقدمه
۶۱ ۲-۴- معرفی الگوی سری زمانی نرخ ارز واقعی متناسب با ساختار اقتصادی ایران
۶۲ ۳-۴- آزمون ریشه واحد برای مانایی
۶۳ ۱-۳-۴- آزمون زیوت- اندروس با یک شکست ساختاری نامعلوم
۶۴ ۴-۴- مدل‌سازی خودرگرسیون برداری (<i>VAR</i>)
۶۵ ۵-۴- تابع واکنش آنی (تابع عکس‌العمل تحریک)
۶۶ ۶-۴- تجزیه واریانس
۶۶ ۷-۴- الگوی <i>VAR</i> و هم‌جمعی (روش جوهانسون)
۶۷ ۸-۴- مدل‌سازی <i>VAR</i> برای واردات کالاهای واسطه‌ای ایران
۷۶ ۱-۹-۴- آزمون علیت گرنجر بلوکی
۷۷ ۲-۹-۴- آزمون علیت استاندارد (تودا- یاماموتو)
۷۹ ۱۰-۴- خلاصه و نتیجه‌گیری
۸۱ فصل پنجم: جمع‌بندی، نتیجه‌گیری و ارائه پیشنهادات
۸۲ ۱-۵- جمع‌بندی نتایج
۸۲ ۲-۵- نقد فرضیات تحقیق
۸۴ ۳-۵- پاسخ به سؤالات تحقیق، نتیجه‌گیری و ارائه پیشنهادات سیاستی
۸۸ ۴-۵- پیشنهادات برای تحقیقات آتی
۸۹ فهرست منابع تحقیق
۸۹ الف: منابع فارسی
۹۵ ب: منابع انگلیسی
۹۸ پیوست

فهرست جدول‌ها

شماره و عنوان جدول	صفحه
۱-۴- مقادیر بحرانی الگوی زیوت- اندروس (۱۹۹۲)	۶۴
۲-۴- نتایج آزمون ریشه واحد ZA و ADF برای متغیرهای الگوی VAR	۶۸
۳-۴- نتایج حاصل از تعیین وقفه بهینه مدل VAR	۶۹
۴-۴- نتایج آزمون اثر (λ_{Trace}) برای تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشتگی	۷۰
۵-۴- نتایج آزمون حداکثر مقدار ویژه (λ_{Max}) برای تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشتگی	۷۰
۶-۴- نتایج برآورد مدل $VECM$ نامقید	۷۰
۷-۴- نتایج برآورد مدل $VECM$ مقید	۷۱
۸-۴- نتایج برآورد ضرایب تعدیل	۷۲
۹-۴- تجزیه واریانس واردات واسطه‌ای ایران طی ۱۵ دوره	۷۵
۱۰-۴- نتایج آزمون علیت بلوکی بین واردات واسطه‌ای و نرخ ارز واقعی	۷۷
۱۱-۴- نتایج آزمون علیت بلوکی بین واردات واسطه‌ای و ارزش افزوده صنعت	۷۷
۱۲-۴- نتایج آزمون علیت تودا- یاماموتو بین واردات واسطه‌ای و نرخ ارز واقعی	۷۸
۱۳-۴- نتایج آزمون علیت تودا- یاماموتو بین واردات واسطه‌ای و ارزش افزوده صنعت	۷۸

فهرست نمودارها

شماره و عنوان نمودار	صفحه
۱-۱- روند واردات واسطه‌ای ایران طی دوره ۱۳۳۸-۸۹	۴
۱-۲- روند متقابل نرخ ارز واقعی و واردات واسطه‌ای ایران طی دوره ۱۳۳۸-۸۹	۲۷
۲-۲- روند واردات ایران طی دوره ۱۳۳۸-۸۹	۳۴
۳-۲- روند انواع واردات طی دوره ۱۳۳۸-۸۹	۳۵
۴-۲- روند نرخ ارز اسمی و نرخ ارز واقعی ایران طی دوره ۱۳۳۸-۸۹	۴۲
۱-۴- ریشه‌های معکوس چند جمله‌ای مشخصه AR	۶۹
۲-۴- پاسخ واردات واسطه‌ای به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر نرخ ارز واقعی	۷۳
۳-۴- پاسخ واردات واسطه‌ای به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر ارزش افزوده صنعت	۷۴
۴-۴- تجزیه واریانس واردات واسطه‌ای طی ۱۵ دوره	۷۶

فهرست پیوست

پیوست	صفحه
پیوست (الف): نتایج آزمون ریشه واحد ZA روی نرخ ارز واقعی ایران	۹۸
پیوست (ب): نتایج آزمون ریشه واحد ZA روی واردات واسطه‌ای ایران	۹۸
پیوست (پ): نتایج آزمون ریشه واحد ZA روی ارزش افزوده صنعت ایران	۹۹
پیوست (ت): نتایج آزمون ریشه واحد ZA روی قیمت نسبی واردات ایران	۱۰۰
پیوست (ث): نتایج آزمون ریشه واحد ADF روی ارزش افزوده صنعت ایران	۱۰۰
پیوست (ج): نتایج آزمون ریشه واحد ADF روی قیمت نسبی واردات ایران	۱۰۱
پیوست (چ): نتایج آزمون ریشه واحد ADF روی نرخ ارز واقعی ایران	۱۰۱
پیوست (ح): نتایج آزمون ریشه واحد ADF روی واردات واسطه‌ای ایران	۱۰۲
پیوست (خ): تعیین وقفه بهینه مدل VAR	۱۰۲
پیوست (د): نتایج تخمین مدل VAR	۱۰۳
پیوست (ذ): تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشتگی با استفاده از λ_{Max} و λ_{Trade}	۱۰۴
پیوست (ر): نتایج تخمین مدل $VECM$ غیرمقید	۱۰۶
پیوست (ز): نتایج تخمین مدل $VECM$ مقید	۱۰۸
پیوست (ژ): نتایج تجزیه واریانس واردات واسطه‌ای	۱۰۹
پیوست (س): نتایج آزمون علیت بلوکی بین نرخ ارز واقعی و واردات واسطه‌ای	۱۱۰
پیوست (ش): نتایج آزمون علیت بلوکی بین ارزش افزوده صنعت و واردات واسطه‌ای	۱۱۰
پیوست (ص): نتایج تخمین SUR بین نرخ ارز واقعی و واردات واسطه‌ای	۱۱۱
پیوست (ض): نتایج آزمون علیت استاندارد از سمت نرخ ارز واقعی به واردات واسطه‌ای	۱۱۱
پیوست (ط): نتایج تخمین SUR بین واردات واسطه‌ای و نرخ ارز واقعی	۱۱۲
پیوست (ظ): نتایج آزمون علیت استاندارد از سمت واردات واسطه‌ای به نرخ ارز واقعی	۱۱۲
پیوست (ع): نتایج تخمین SUR بین ارزش افزوده صنعت و واردات واسطه‌ای	۱۱۳
پیوست (غ): نتایج آزمون علیت استاندارد از سمت ارزش افزوده صنعت به واردات واسطه‌ای	۱۱۳
پیوست (ف): نتایج تخمین SUR بین واردات واسطه‌ای و ارزش افزوده صنعت	۱۱۴
پیوست (ق): نتایج آزمون علیت استاندارد از سمت واردات واسطه‌ای به ارزش افزوده صنعت	۱۱۴

فصل اول

کلیات تحقیق

سیر تکامل بشر به ویژه پیشرفت‌های تکنولوژیکی قرن حاضر در زمینه‌های مختلف، دنیا را به مجموعه‌ای کوچک و به هم پیوسته بدل نموده است. بارزترین ویژگی این پیوستگی، ایجاد روابط بین‌الملل می‌باشد. ضرورت چنین ارتباطی از توزیع نابرابر منابع در سطح زمین است. کشورها به لحاظ منابع طبیعی، آب و هوا و شرایط جغرافیایی و اکولوژیک از یک سو و منابع انسانی و مالی از سوی دیگر تفاوت دارند. به همین جهت مقوله تجارت بین‌الملل و تبادل کالاها و خدمات بین کشورهای مختلف از اهمیت بسزایی برخوردار شده و در این راستا و در تنظیم سیاست‌های کلان اقتصادی، اتخاذ مجموعه‌ای از سیاست‌های ارزی، تجاری، پولی و مالی و سیاست‌های مکمل که به طور کامل هماهنگ باشند، بسیار اهمیت دارد. تجارت خارجی باید ابزاری جهت رشد و توسعه اقتصادی و کوششی در راستای ارتقای سطح زندگی و رفاه اجتماعی باشد. بنابراین، بررسی بخش بازرگانی بین‌الملل در هر کشور، به خصوص کشورهای در حال توسعه از جمله ایران، از اهمیت بالایی برخوردار است.

واردات به عنوان یکی از مهم‌ترین اجزای بخش بازرگانی خارجی و تراز تجاری همواره مورد توجه سیاست‌گذاران بوده و شناخت عوامل مؤثر بر آن مورد تأکید قرار گرفته است. در این بین کشورهای در حال توسعه با توجه به نواقص ساختاری و کمبود و عدم کارایی نهاده‌های تولید، همواره نیاز به واردات کالاها به خصوص کالاهای واسطه‌ای دارند؛ چرا که نقش بسزایی در ایجاد فرصت‌ها، زیرساخت‌ها و تقویت بخش تولید ایفا می‌نماید. از طرفی می‌توان گفت نرخ ارز اصلی‌ترین متغیر مؤثر بر تراز پرداخت‌ها است که علاوه بر تأثیر بر بخش خارجی کشور می‌تواند بر چالش‌های بخش داخلی نیز مؤثر باشد. عدم تعادل‌های جاری در سطح کلان و بحران تراز پرداخت‌ها اغلب نتیجه مستقیم انحراف نرخ ارز از مسیر تعادلی بلندمدت است. بنابراین می‌توان گفت بررسی رابطه نوسانات نرخ ارز و بالاخص نرخ ارز واقعی و واردات کالاهای واسطه‌ای در اقتصاد کشورهای در حال توسعه از جمله ایران که همواره سهم بالایی (بالغ بر ۶۰ درصد) از واردات آن را کالاهای واسطه‌ای تشکیل می‌دهد و تغییرات مداوم نرخ ارز اقتصاد را با چالش‌های فراوان روبرو نموده است، دارای اهمیتی دوچندان می‌باشد.

در این فصل همچون روال معمول سایر پایان‌نامه‌ها کلیاتی از موضوع مورد مطالعه بیان می‌کنیم. مهم‌ترین بخش‌های این کلیات شامل بیان مسئله و سؤالات اصلی، سابقه و ضرورت انجام، فرضیات، اهداف و روش انجام

تحقیق می‌باشد که هر یک در جای خود به تفصیل بیان خواهد شد. سایر بخش‌ها همچون کاربردها و نوآوری طرح، منابع آماری و اطلاعاتی و محدودیت‌های تحقیق نیز در ادامه مطالب این فصل بیان خواهد شد.

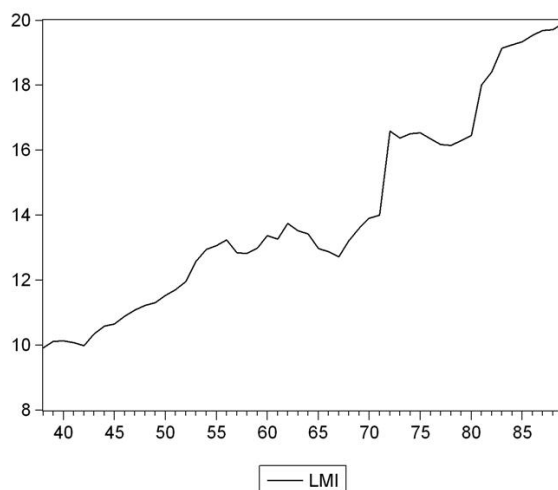
۱-۲- بیان مسئله و سؤالات اصلی تحقیق

از جمله عوامل مؤثر در رشد اقتصادی در کشورهای در حال توسعه، اتکا به تجارت خارجی است. به طور کلی فرآیند رشد اقتصادی کشورهای در حال توسعه، به علت وابستگی زیاد به درآمدهای صادراتی و ارزی برای واردات، تجارت خارجی نقش اساسی ایفا می‌کند. درآمدهای ارزی صادراتی منبعی برای واردات کالاها و خدمات محسوب می‌شود. از یک سو، یکی از معیارها در ارزیابی بنیه اقتصادی هر کشور، تراز تجاری و اجزای آن، صادرات و واردات می‌باشد، بنابراین تغییر و تحول در واردات کشور منجر به تأثیر بر فرآیند تولید، رشد و توسعه خواهد شد. در این میان واردات کالاهای واسطه‌ای می‌تواند صنایع را در داخل کشور رقابتی‌تر کند و در نهایت موجب کاهش تورم و افزایش توان انتخاب مصرف‌کنندگان شود (جلال‌آبادی و همکاران، ۱۳۸۶). لذا اتخاذ سیاست وارداتی صحیح، به خصوص در زمینه واردات کالاهای واسطه‌ای حائز اهمیت بوده، در نتیجه شناخت عوامل مؤثر بر واردات کالاهای واسطه‌ای ضروری به نظر می‌رسد.

از دیگر سو، یکی از مباحث مهم در اقتصاد کلان، اثر نوسانات نرخ ارز بر متغیرهای کلان اقتصادی است؛ چرا که این نوسانات هم بخش تقاضای کل را از مجرای خالص صادرات و تأثیرگذاری ذخایر ارزی بانک مرکزی، و هم بخش عرضه اقتصاد را از مجرای کالاهای واسطه‌ای وارداتی، تحت تأثیر قرار می‌دهد (کازرونی و رستمی، ۱۳۸۶). کشور ایران، به عنوان یک کشور در حال توسعه و با برخورداری از منابع طبیعی فراوان، به دلیل وابستگی شدید به درآمدهای ارزی حاصل از صدور منابع طبیعی و به خصوص صادرات نفت، نتوانسته بخش بازرگانی بین‌الملل را به درستی شناسایی کرده و مورد تحلیل قرار دهد. به همین جهت همواره با مشکلاتی در تراز پرداخت‌ها و حساب جاری خود روبرو بوده، به طوری که سهم عظیمی از درآمدهای حاصل از صدور نفت به واردات کالاها اختصاص یافته و حساب جاری را با کسری مواجه نموده است (توفیقی و محرابیان، ۱۳۸۱). البته واردات به خودی خود امری منفی نیست بلکه گاهی می‌تواند به افزایش رقابت صنایع داخلی و تولید کالاهای باکیفیت‌تر منجر شود، اما به دلیل فقدان نیروی انسانی کارآمد و تکنولوژی مناسب در داخل کشور، واردات و بالاخص واردات کالاهای واسطه‌ای

همچنان نتوانسته موجب رونق بخش تجاری کشور به عنوان موتور رشد اقتصاد گردد (جلال‌آبادی و همکاران، ۱۳۸۶ و سپانلو و قنبری، ۱۳۸۹).

واردات در ایران به ۳ بخش کالاهای سرمایه‌ای، کالاهای واسطه‌ای و کالاهای مصرفی تقسیم می‌شود. در سال ۱۳۸۹ واردات کالاهای واسطه‌ای با ارزش ۳۷۰۴۲/۲۹ میلیون دلار سهم ۶۷/۵ درصدی از کل واردات کشور را به خود اختصاص داده و نسبت به سال ۱۳۳۸ که سهم واردات این نوع کالا با ارزش ۲۶۷/۵ میلیون دلار برابر ۴۹ درصد بوده، رشد چشمگیری را نشان می‌دهد. نمودار (۱-۱) روند این نوع واردات را نشان می‌دهد.



نمودار ۱-۱: روند واردات واسطه‌ای ایران طی دوره ۱۳۳۸-۸۹ (مأخذ: نتایج تحقیق)

از سوی دیگر، نرخ ارز در بازار رسمی از هر دلار برابر ۷۶ ریال در سال ۱۳۳۸ به رقم هر دلار برابر ۱۰۶۱۶/۳ ریال در سال ۱۳۹۰ رسیده و در این میان با نوسانات زیادی روبرو بوده است (ترازنامه بانک مرکزی، سال‌های مختلف). بنابراین بررسی بخش تجاری و به خصوص واردات واسطه‌ای به دلیل سهم بالای آن در واردات، تولید و عرضه کشور و نرخ ارز واقعی به عنوان یکی از مهم‌ترین عوامل مؤثر بر آن که نوسانات آن کلیه بخش‌های اقتصاد را تحت تأثیر قرار می‌دهد، از اهمیت زیادی برخوردار است. لذا این پژوهش به دنبال بررسی رابطه و میزان اثرپذیری واردات کالاهای واسطه‌ای از نوسانات نرخ ارز واقعی بوده و به دنبال پاسخگویی به سؤالات اساسی زیر است:

۱- آیا رابطه معنی‌داری بین نوسانات نرخ ارز واقعی و واردات کالاهای واسطه‌ای در ایران وجود دارد؟ در صورت وجود چنین رابطه‌ای، نوع و میزان آن چگونه است؟

۲- آثار و تبعات سیاست‌های مختلف ارزی اتخاذ شده ایران بر نرخ ارز واقعی و واردات کالاهای واسطه‌ای طی دوره

۸۹-۱۳۳۸ چیست؟

۳- سیاست صحیح و متناسب با ساختار اقتصادی ایران در رابطه با کنترل نوسانات ارزی چیست؟

۴- آیا رابطه معنی‌داری بین شاخص رشد بخش صنعت و واردات واسطه‌ای وجود دارد؟

۳-۱- ضرورت انجام تحقیق

تجربه بسیاری از کشورها نشان می‌دهد تنها کشورهایی می‌توانند ابتکار عمل را در بخش تجارت خارجی در دست داشته باشند که با توجه به اهداف بلندمدت اقتصادی- اجتماعی، برنامه‌ریزی کرده باشند. کشورهایی که سیاست‌های صحیحی انجام داده‌اند، ضمن بکارگیری امکانات در راستای توسعه، از بروز بحران‌هایی همچون بحران تراز پرداخت‌ها جلوگیری کرده‌اند. بدیهی است در این راستا شناخت دقیق صادرات و واردات و عوامل مؤثر بر آنها الزامی است (تشکینی و باستانی، ۱۳۸۵).

نرخ ارز به عنوان معیار ارزش برابری پول ملی یک کشور در برابر پول کشورهای دیگر، منعکس‌کننده وضعیت اقتصادی آن کشور در سطح بین‌الملل است. در یک اقتصاد باز، نرخ ارز به دلیل ارتباط متقابل با سایر متغیرهای داخلی و خارجی، متغیری کلیدی به شمار می‌رود که سیاست‌های اقتصادی داخلی، خارجی و تحولات اقتصادی تأثیر بسیاری بر آن می‌گذارند. در مقابل، نرخ ارز نیز متغیری است که می‌تواند عملکرد اقتصاد و متغیرهای اقتصادی را تحت تأثیر قرار دهد (آقایی و همکاران، ۱۳۸۷). این نرخ از طریق بازار کالا و دارایی، روابط بین قیمت‌های داده شده در بازار جهانی را برقرار می‌سازد و یک عامل مؤثر بر سیاست‌ها، راهبردها، ساز و کارهای روزانه، ساختار سیاستی، اجتماعی و فرهنگی محسوب می‌شود. نرخ ارز بر قیمت کالاها و خدمات وارداتی از جمله، کالاهای واسطه- ای تأثیر دارد (موسوی‌محسنی و سبحانی‌پور، ۱۳۸۷). در صورتی که با اعمال سیاست‌های اقتصادی یا هر دلیل دیگر، نرخ ارز در کشور افزایش یابد، به دلیل اینکه حجم وسیعی از واردات، شامل کالاهای واسطه‌ای مورد نیاز کارخانجات است، قیمت این کالاها متأثر شده و به افزایش قیمت کالاهای واسطه‌ای وارداتی و افزایش تمام شده تولیدات داخلی منجر خواهد شد (حسینی و همکاران، ۱۳۸۶). برای رفع مشکلات اقتصاد پولی در ایران از جمله تورم و به منظور نیل به حفظ تعادل اقتصاد داخلی و خارجی همراه با رشد اقتصادی، هماهنگی بین سیاست‌های

پولی، مالی و ارزی و توجه به تأثیر تغییر قیمت‌ها و نرخ ارز روی اقتصاد داخلی و روابط بین‌الملل ضروری می‌نماید (موسوی‌محسنی و سبحانی‌پور، ۱۳۸۷).

۴-۱- فرضیات تحقیق

با توجه به تغییرات سریع سیاست‌های نرخ ارز در ساختار اقتصادی ایران، لازم است به بررسی نرخ ارز در ایران و تأثیر آن بر متغیرهای کلان اقتصادی، از جمله واردات کالاهای واسطه‌ای، به دلیل حجم و سهم بالای این گروه کالاها از کل واردات در کشور بپردازیم. در همین راستا، در این پژوهش به دنبال آزمون فرضیه‌های زیر می‌باشیم:

- ۱- بین نوسانات نرخ ارز واقعی و واردات کالاهای واسطه‌ای در ایران رابطه معنی‌داری وجود دارد.
- ۲- بین شاخص رشد بخش صنعت و واردات کالاهای واسطه‌ای در ایران رابطه معنی‌داری وجود دارد.
- ۳- نوسانات نرخ ارز واقعی در کوتاه‌مدت تأثیری بر واردات کالاهای واسطه‌ای ندارد، اما در بلندمدت موجب کاهش واردات این گروه کالاها می‌شود.
- ۴- رابطه علیت بین نوسانات نرخ ارز واقعی و واردات واسطه‌ای به صورت یک طرفه و از سمت نوسانات نرخ ارز واقعی به واردات کالاهای واسطه‌ای است.
- ۵- رابطه علیت بین شاخص رشد بخش صنعت و واردات واسطه‌ای به صورت دو طرفه است.

۵-۱- اهداف تحقیق

تعیین جایگاه و نقش سازنده تجارت خارجی در مجموعه فعالیت‌های اقتصادی کشورها از جمله کشور ایران، از اهمیت ویژه‌ای برخوردار است. بدین روی شناخت ساختار واردات کشور، اجزای آن و عوامل مؤثر بر آن، از جمله نرخ ارز واقعی، به عنوان یکی از مهم‌ترین مسائل تجارت خارجی، امری ضروری محسوب می‌شود. لذا این پژوهش اهداف زیر را دنبال می‌کند:

- ۱- شناخت روابط کوتاه‌مدت و بلندمدت نوسانات نرخ ارز واقعی و واردات کالاهای واسطه‌ای؛
- ۲- تعیین نوع و میزان اثرپذیری واردات کالاهای واسطه‌ای از نوسانات نرخ ارز واقعی؛
- ۳- ارزیابی آثار و تبعات سیاست‌های مختلف ارزی اتخاذ شده در ایران طی دوره ۸۹-۱۳۳۸؛
- ۴- تعیین نوع و میزان اثرپذیری واردات کالاهای واسطه‌ای از شاخص رشد بخش صنعت؛

۵- بررسی رابطه علّیت بین متغیرها؛

۶- شفاف نمودن و شناسایی سیاست‌های ارزی و وارداتی متناسب با ساختار اقتصادی کشور؛

۷- ارائه پیشنهادات علمی و کمک به ایجاد راهکارهای بهبود تصمیم‌گیری‌های تجارتي؛

۱-۶- کاربردهای تحقیق

شناسایی عوامل مؤثر بر شرایط اقتصادی کشور و بررسی علمی آنها می‌تواند به ارائه راهکارهای مناسب جهت اعمال سیاست‌های صحیح اقتصادی و کمک به اجرای دقیق این سیاست‌ها و برنامه‌ریزی در راستای پیشبرد اهداف منجر شود. در این پژوهش به بررسی رابطه نوسانات نرخ ارز واقعی و واردات کالاهای واسطه‌ای می‌پردازیم تا با شناخت این رابطه بتوانیم پیشنهادهای سیاستی مناسبی را ارائه دهیم و با برنامه‌ریزی‌های صحیح در جهت بهبود شرایط اقتصادی کشور گام برداریم؛ چرا که در نتیجه عدم اجرای سیاست مناسب و هماهنگ با سیاست‌های پولی و مالی و یا اصلاحات ساختاری نامتناسب که خود باعث نوسانات نرخ ارز می‌شود، می‌تواند اثرات نامطلوبی همچون تورم، کاهش تولید، افزایش بیکاری و تشدید کسری بودجه را به همراه داشته باشد. لذا این پژوهش با بررسی دقیق و علمی موضوع مورد مطالعه می‌تواند علاوه بر ایجاد زمینه مناسب برای مطالعات بعدی، به سیاست‌گذاران و برنامه‌ریزان اقتصادی در سازمان‌ها و مراجع ذیربط در برنامه‌ریزی و اجرای اهداف خود کمک شایانی برساند.

۱-۷- استفاده‌کنندگان از نتایج تحقیق

نتایج این پژوهش علاوه بر اینکه روشنگر راهی برای محققین درون دانشگاهی و پژوهشگران برون دانشگاهی جهت مطالعات آتی است، می‌تواند مورد حمایت مسئولین و سازمان‌های مرتبط از جمله وزارت امور اقتصادی و دارایی، وزارت صنعت و معدن و تجارت، اتاق بازرگانی، صنایع و معادن و کشاورزی و سایر مراجع قرار گیرد و با ارائه پیشنهادات علمی و بیان راهکارهای صحیح، آنها را در راستای شناخت هرچه بهتر شرایط اقتصادی کشور و تصمیم‌گیری‌های دقیق و علمی‌تر یاری نماید.