



دانشکده اقتصاد، مدیریت و بازرگانی

گروه اقتصاد

پایان نامه

جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد در رشته توسعه اقتصادی و برنامه‌ریزی

عنوان

انتقال اثر نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات در ایران و شرکای تجاری منتخب

استاد راهنما

دکتر حسین اصغریپور

استاد مشاور

دکتر بهزاد سلمانی

پژوهشگر

زینب حیدری داد

شهریور ۱۳۹۱

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

تقدیم به او:

که بقای بودمان از اوست...

تقدیم به

پدر و مادر عزیزم به پاس همه زحمات شان در تمام سال های زندگی ام و بوسه بردستان زحمت کششان

به برادر و خواهر های عزیزم، به پاس همه حمایت هایشان

تقدیر و شکر

حمد و سپاس خدایی راست که، هستی را بر اساس قدرت بی‌کرانش بنیان نهاد و بشر را به آموختن اسرار آن رهنمون شد. خداوند حکیمی که ذره ذره کائنات جلوه‌ای از عظمت و علم بی‌انتهای او هستند.

مشکرمی کنم از تمام کسانی که مرا آموخته‌اند، آنهایی که درس زندگی دادند، از آنانی که به من یاد دادند که به انسانیت عشق بورزم، آنانی که یاد دادند که آنگاه بشنیدم و دسم را بشویم، آنانی که در پای تخته سیاه استشام کردند، سم کج را، تا که با عشق خود، بی‌افروختند آتش علم را.

از استاد بزرگوارم جناب آقای دکتر حسین اصغرپور که نه تنها به عنوان استاد راهنما، در تمامی مراحل انجام این تحقیق از راهنمایی‌ها و کمک‌های بی‌دیغ ایشان بهره‌مند شده‌ام، بلکه از وی درس زندگی آموختم، مشکرم و قدر دانی می‌کنم. همچنین از زحمات بی‌دیغ استاد بزرگوارم جناب آقای دکتر بهزاد سلمانی که در انجام کار اینجانب را، یاری و مساعدت نمودند نهایت مشکرم را دارم، از استاد عزیز، جناب آقای دکتر فیروز فلاحی که زحمت دآوری این پژوهش را مستقبل شدند، کمال سپاس را دارم. همچنین بر خود لازم می‌دانم از اساتید بزرگوارم جناب آقای دکتر محمدباقر بهشتی و جناب آقای دکتر پرویز محمدزاده که بسیار از ایشان آموختم، به پاس آموخته‌هایم قدر دانی نمایم.

در پایان از تمامی دوستان عزیزم به‌طور ویژه دوست و خواهر عزیزم خانم زینب علی‌نیا در دانشگاه و هم‌اتاقی‌های عزیزم خانم هانم زینب جامه‌شورانی، مریم پلکنی و بهاره رحیمی پور که مایه دلگرمی ام بودند سپاسگزارم.

زینب حدیدی داد

نام خانوادگی: حیدری داد	نام: زینب
عنوان پایان نامه: انتقال اثر نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات در ایران و شرکای تجاری منتخب	
استاد راهنما: دکتر حسین اصغرپور	استاد مشاور: دکتر بهزاد سلمانی
مقطع تحصیلی: کارشناسی ارشد	رشته: توسعه اقتصادی و برنامه ریزی
دانشگاه: تبریز	دانشکده: اقتصاد، مدیریت و بازرگانی
تعداد صفحات: ۱۰۸	
واژه‌های کلیدی: انتقال نرخ ارز، رقابت پذیری، شرکای منتخب تجاری، رویکرد پانل	
JEL classification: E31, F30, F41, c33	
<p>چکیده:</p> <p>گسترش صادرات یکی از راهکارهای مهم در رسیدن به رشد اقتصادی در کشورهای توسعه یافته و در حال توسعه می باشد. برای اقتصادهای در حال توسعه و بخصوص کشورهایی که استراتژی توسعه صادرات را دنبال می نمایند، بررسی میزان انتقال اثر نرخ ارز بر قیمت صادرات موضوعی مهم است و بایستی تغییرات نرخ ارز طوری تنظیم شود که رقابت پذیری آنها در بازارهای صادراتی را تضمین نماید. از این رو، بررسی تجربی میزان انتقال نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات کشورها می تواند مسئولین اقتصادی کشورها را در برنامه ریزی و تحقق اهداف برنامه های توسعه صادرات یاری نماید در این راستا، در این مطالعه با بهره گیری از داده های تابلویی ایران و شرکای تجاری منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ میزان انتقال نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات با تاکید تاثیر شرایط اقتصادی کشورها بر میزان انتقال نرخ ارز مورد تجزیه و تحلیل و کنکاش علمی قرار گرفته است. نتایج مطالعه حاکی از وجود یک رابطه مثبت و معنی دار میان نرخ ارز و شاخص قیمت صادرات وجود دارد. یافته های نشان دهنده انتقال ناقص نرخ ارز در ایران و شرکای تجاری منتخب آن می باشد. همچنین یافته های مطالعه نشان می دهند که در سطوح تورمی بالا از میزان انتقال نرخ ارز به شاخص قیمت صادرات کاسته می شود و در مجموعه کشورهای توسعه یافته در برابر کشورهای در حال توسعه میزان انتقال نرخ ارز کم تر می باشد که نشان از مواجه شدن با رقابت کم تر در این کشورها می باشد.</p>	

فهرست مطالب

۱	فصل اول
۲	۱-۱- بیان مسئله
۳	۱-۲- اهمیت و ضرورت موضوع
۴	۳-۱- هدف
۴	۴-۱- سؤال تحقیق
۴	۵-۱- فرضیه تحقیق
۵	۶-۱- جامعه آماری
۵	۷-۱- محدودیت های تحقیق
۶	۸-۱- سازماندهی تحقیق
۷	فصل دوم
۸	۱-۲- مقدمه
۸	۲-۲- مبانی نظری
۱۲	۳-۲- مروری بر مطالعات انجام شده
۱۲	۱-۳-۲- مطالعات خارجی
۱۸	۲-۳-۲- مطالعات داخلی
۲۱	جمع بندی فصل
۲۳	فصل سوم
۲۴	مقدمه
۲۴	۱-۳- بررسی سهم صادرات ایران و شرکای تجاری منتخب از صادرات کل جهان
۲۵	۲-۳- بررسی روند تولید ناخالص داخلی سرانه
۲۸	۳-۳- روند شاخص قیمت صادرات
۲۹	۴-۳- روند متغیر شاخص عمده فروشی در طول زمان

۲۹۵-۳- روند متغیر نرخ تورم در طول زمان
۳۰۶-۳- روند شاخص باز بودن اقتصادی طی زمان
۳۱۸-۳- رابطه بین نرخ ارز و شاخص قیمت صادرات
۳۴۹-۳- رابطه بین قیمت عمدهفروشی و شاخص قیمت صادرات
۳۶۱۰-۳- رابطه بین نرخ تورم و شاخص قیمت صادرات
۳۸۱۱-۳- رابطه بین شاخص باز بودن اقتصادی و شاخص قیمت صادرات
۴۱ جمع بندی
۴۲ فصل چهارم
۴۳۱-۴- مقدمه
۴۳۲-۴- مدل تحقیق
۴۵۳-۴- تعریف عملیاتی متغیرها
۴۶۳-۴- معرفی روش تحقیق
۴۸۲-۳-۴- روش های تخمین مدل با داده های پانل
۴۹ (ب) آزمون معنیدار بودن اثرات گروه
۵۰ (ت) آزمون معنی دار بودن اثرات تصادفی (آزمون بروش - پاگان)
۵۰ (ج) آزمون مخصوص هاسمن برای مدل تصادفی
۵۱۳-۳-۴- آزمون ایستایی در داده های پانل
۵۲۱-۳-۳-۴- آزمون ایستایی لوین، لین و چو (LLC)
۵۳۲-۳-۳-۴- آزمون ایستایی ایم، پسران و شین (IPS)
۵۴۳-۳-۳-۴- آزمون فیشر
۵۵۵-۳- جمع بندی
۵۶ فصل پنجم
۵۷۱-۵- مقدمه

۵۷ ۲-۵- مروری بر مدل تحقیق
۵۸ ۳-۵- آزمونهای ایستایی متغیرها
۵۸ ۱-۳-۵- آزمون ریشه واحد LLC
۵۹ ۲-۳-۵- آزمون ریشه واحد IPS
۶۰ ۳-۳-۵- آزمون ریشه واحد فیشر
۶۰ ۴-۵- نتایج برآوردها
۸۹ ۵-۵- جمع بندی
۹۰ فصل ششم
۹۱ ۱-۶- مقدمه
۹۱ ۲-۶- مروری بر خطوط کلی پژوهش
۹۳ ۳-۶- نتیجه آزمون فرضیه تحقیق
۹۴ ۴-۶- بحث و نتیجه گیری
۹۶ ۵-۶- پیشنهاد های سیاستگذاری
۹۷ ۶-۶- پیشنهاد برای پژوهشهای آتی
۹۸ منابع و مأخذ
۹۹ فارسی
۹۹ انگلیسی
۱۰۰ ضمائم

فهرست جداول:

- جدول ۲-۱: خلاصه مطالعات خارجی و داخلی صورت گرفته ۱۹
- جدول ۳-۱: میانگین متغیرها در نمونه مورد مطالعه طی دوره ۲۰۰۷-۱۹۷۵ ۳۰
- جدول ۵-۱: نتایج آزمون ریشه واحد LLC برای متغیرهای مدل در سطح ۵۹
- جدول ۵-۲: نتایج آزمون ریشه واحد IPS برای متغیرهای مدل در سطح ۵۹
- جدول ۵-۳: نتایج آزمون ریشه واحد Fisher برای متغیرهای مدل در سطح ۶۰
- جدول ۵-۴: آزمون معنی دار بودن اثرات ثابت مرحله اول ۶۱
- جدول ۵-۵: آزمون معنی داری اثرات تصادفی مرحله اول ۶۱
- جدول ۵-۶: نتایج آزمون هاسمن مرحله اول ۶۲
- جدول ۵-۷: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش اثرات تصادفی مرحله اول ۶۲
- جدول ۵-۸: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله اول ۶۳
- جدول ۵-۹: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله اول ۶۴
- جدول ۵-۱۰: تخمین مدل به روش GLS همراه با در نظر گرفتن $AR(1)$ مرحله اول ۶۴
- جدول ۵-۱۱: آزمون معنی دار بودن اثرات ثابت مرحله دوم ۶۵
- جدول ۵-۱۲: آزمون معنی داری اثرات تصادفی مرحله دوم ۶۵
- جدول ۵-۱۳: نتایج آزمون هاسمن مرحله دوم ۶۶
- جدول ۵-۱۴: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش اثرات ثابت مرحله دوم ۶۶
- جدول ۵-۱۵: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله دوم ۶۷
- جدول ۵-۱۶: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله دوم ۶۷
- جدول ۵-۱۷: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش GLS همراه با لحاظ $AR(1)$ مرحله دوم ۶۷
- جدول ۵-۱۹: آزمون معنی داری اثرات تصادفی مرحله سوم ۶۹
- جدول ۵-۲۰: نتایج آزمون هاسمن مرحله سوم ۶۹
- جدول ۵-۲۱: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش اثرات ثابت مرحله سوم ۶۹
- جدول ۵-۲۲: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله سوم ۷۰
- جدول ۵-۲۳: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله سوم ۷۰
- جدول ۵-۲۴: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش GLS همراه با لحاظ $AR(1)$ مرحله سوم ۷۰
- جدول ۵-۲۵: آزمون معنی دار بودن اثرات ثابت مرحله چهارم ۷۲

- جدول ۵-۲۶: آزمون معنی‌داری اثرات تصادفی مرحله چهارم ۷۲
- جدول ۵-۲۷: نتایج آزمون هاسمن مرحله چهارم ۷۲
- جدول ۵-۲۸: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش اثرات تصادفی مرحله چهارم ۷۳
- جدول ۵-۲۹: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله چهارم ۷۳
- جدول ۵-۳۰: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله چهارم ۷۳
- جدول ۵-۳۱: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش GLS همراه با لحاظ $AR(1)$ مرحله چهارم ۷۴
- جدول ۵-۳۲: آزمون معنی‌دار بودن اثرات ثابت مرحله پنجم ۷۵
- جدول ۵-۳۳: آزمون معنی‌داری اثرات تصادفی مرحله پنجم ۷۵
- جدول ۵-۳۴: نتایج آزمون هاسمن مرحله پنجم ۷۶
- جدول ۵-۳۵: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش اثرات ثابت مرحله پنجم ۷۶
- جدول ۵-۳۶: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله پنجم ۷۶
- جدول ۵-۳۷: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله پنجم ۷۷
- جدول ۵-۳۸: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش GLS همراه با لحاظ $AR(1)$ مرحله پنجم ۷۷
- جدول ۵-۳۹: آزمون معنی‌دار بودن اثرات ثابت مرحله ششم ۷۹
- جدول ۵-۴۰: آزمون معنی‌داری اثرات تصادفی مرحله ششم ۷۹
- جدول ۵-۴۱: نتایج آزمون هاسمن مرحله ششم ۷۹
- جدول ۵-۴۲: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش اثرات ثابت مرحله ششم ۸۰
- جدول ۵-۴۳: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله ششم ۸۰
- جدول ۵-۴۴: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله ششم ۸۱
- جدول ۵-۴۵: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش GLS با لحاظ $AR(1)$ مرحله ششم ۸۱
- جدول ۵-۴۶: آزمون معنی‌دار بودن اثرات ثابت مرحله هفتم ۸۳
- جدول ۵-۴۷: آزمون معنی‌داری اثرات تصادفی مرحله هفتم ۸۳
- جدول ۵-۴۸: نتایج آزمون هاسمن مرحله هفتم ۸۳
- جدول ۵-۵۰: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس مرحله هفتم ۸۴
- جدول ۵-۵۱: نتایج آزمون خود همبستگی مرحله هفتم ۸۴
- جدول ۵-۵۲: نتایج حاصل از تخمین مدل به روش GLS همراه با لحاظ $AR(1)$ مرحله هفتم ۸۴
- جدول ۵-۵۳: خلاصه میزان انتقال نرخ ارز به تفکیک شرایط ۸۵
- جدول ۵-۵۴: نتایج آزمون والد برای ضرایب دو متغیر نرخ ارز و هزینه نهایی تولید ۸۷

جدول ۵-۵۵: نتایج ۷ مرحله تخمین به طور خلاصه ۸۷

جدول ۶-۱: نتایج آزمون فرضیه تحقیق ۹۴

فهرست نمودارها

- نمودار ۳-۱: متوسط سهم متوسط صادرات کشورهای مورد مطالعه از صادرات جهان طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۲۵
- نمودار ۳-۲: روند تولید ناخالص داخلی سرانه ایران و شرکای تجاری منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۲۷
- نمودار ۳-۳: روند تولید ناخالص داخلی سرانه: پاکستان و ایران طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۲۷
- نمودار ۳-۴: روند شاخص قیمت صادرات ایران و شرکای تجاری منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۲۸
- نمودار ۳-۵: روند شاخص قیمت صادرات ایران و شرکای تجاری منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۲۹
- نمودار ۳-۶: روند نرخ تورم ایران و شرکای تجاری منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۳۰
- نمودار ۳-۷: روند شاخص بازبودن اقتصادی ایران و شرکای تجاری منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۳۱
- نمودار ۳-۸: نمودار پراکنش متوسط نرخ ارز و شاخص قیمت صادرات ایران و شرکای تجاری منتخب ۳۲
- نمودار ۳-۹: پراکنش بین نرخ ارز و شاخص قیمت در کشورهای منتخب طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۳۳
- نمودار ۳-۱۰: پراکنش بین نرخ ارز و شاخص قیمت صادرات با استفاده از داده های تلفیقی کشورهای منتخب ۳۳
- نمودار ۳-۱۱: نمودار پراکنش متوسط شاخص قیمت عمده فروشی و شاخص قیمت صادرات ۳۵
- نمودار ۳-۱۲: پراکنش بین شاخص قیمت عمده فروشی و شاخص قیمت صادرات در کشورهای منتخب ۳۵
- نمودار ۳-۱۳: پراکنش بین شاخص قیمت عمده فروشی و شاخص قیمت صادرات با استفاده از داده های تلفیقی ۳۶
- نمودار ۳-۱۴: نمودار پراکنش متوسط نرخ تورم و شاخص قیمت صادرات در ایران و شرکای تجاری منتخب ۳۷
- نمودار ۳-۱۵: پراکنش بین متغیر نرخ تورم و شاخص قیمت صادرات طی دوره ۱۹۷۵-۲۰۰۷ ۳۷
- نمودار ۳-۱۶: پراکنش بین نرخ تورم و شاخص قیمت صادرات با استفاده از داده های تلفیقی کشورهای منتخب ۳۸
- نمودار ۳-۱۷: نمودار پراکنش متوسط میان شاخص باز بودن تجاری و شاخص قیمت صادرات ۳۹
- نمودار ۳-۱۸: نمودار پراکنش میان شاخص باز بودن تجاری و شاخص قیمت صادرات ۳۹
- نمودار ۳-۱۹: پراکنش بین باز بودن تجاری و شاخص قیمت صادرات با استفاده از داده های تلفیقی ۴۰

فصل اول

کلیات تحقیق

۱-۱- بیان مسئله

تجربه کشورهای شرق آسیا در دهه ۱۹۹۰ نشان داد که گسترش صادرات می‌تواند یکی از راهکارهای بسیار مهم و اثربخش جهت دستیابی به رشد اقتصادی در کشورهای در حال توسعه محسوب شود. علت این امر این است که در نبود بازارهای داخلی گسترده برای کالاهای مصرفی، حرکت در مسیر صنعتی- شدن و گسترش تولید به مقیاس کارا، تنها از طریق افزایش صادرات ممکن می‌باشد. مالیک و مارکوس^۱ (۲۰۰۸) اشاره می‌کنند که بدیهی است که میزان موفقیت صادرات هر کشور به رقابت پذیری نسبی محصولات تولیدکنندگان آن کشور بستگی دارد. یکی از شاخص‌های متداول رقابت پذیری صادرات، شاخص قیمت صادرات می‌باشد. در این رابطه میزان اثر انتقال نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات^۲ کشورها می‌تواند قدرت رقابت پذیری صادرات کشور را نمایان سازد.

در بین سال‌های ۱۹۴۷ تا ۱۹۷۱ میلادی کشورهای عضو صندوق بین‌المللی پول مجبور به پذیرش و اعمال نظام ارزی برتون وودز بودند، ولی پس از متوقف شدن این نظام ارزی، کشورهای جهان (توسعه یافته و در حال توسعه) می‌توانستند بنا بر ملاحظات و شرایط اقتصادی خود، نظام ارزی مورد نظر خود را به نظام شناور تبدیل کنند. پس در این دوره نرخ ارز یکی از عوامل مهم تعیین کننده قیمت صادرات کشورها محسوب می‌شود. در این راستا، چگونگی اثرات تغییرات نرخ ارز بر صادرات مسئله مهم و قابل توجهی است که در فرآیند توسعه صادرات اهمیت بسزایی دارد. مطابق ادبیات اقتصادی، چنانچه با افزایش نرخ ارز^۳ (کاهش ارزش پول ملی^۴) قیمت صادرات افزایش یابد، قدرت رقابتی صادرات کم شده و این امر موجب کاهش صادرات حقیقی خواهد شد.

بررسی مطالعات تجربی انتقال اثر نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات در کشورهای مختلف دلالت بر این دارد که ساختار اقتصادی حاکم بر کشورها نقش تعیین کننده‌ای در میزان انتقال اثر نرخ ارز داشته-

^۱ Mallick and Marques

^۲ میزان انتقال نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات معادل کشش قیمت صادرات نسبت به نرخ ارز می‌باشد. به طوری که اگر به ازای یک درصد تغییرات نرخ ارز، قیمت صادرات یک درصد تغییر کند، انتقال اثر نرخ ارز به قیمت صادرات کامل بوده و در صورتی که عکس العمل قیمت صادرات نسبت به تغییرات نرخ ارز کمتر از یک درصد باشد، انتقال اثر نرخ ارز ناقص خواهد بود.

^۳ ارزش هر واحد پول خارجی بر حسب پول داخلی

^۴ Devaluation

است. در این راستا، چگونگی و یا میزان انتقال اثر نرخ بر شاخص قیمت صادرات در ایران و شرکای تجاری سوال مهم و قابل مطرح می‌باشد.

۲-۱- اهمیت و ضرورت موضوع

در دهه های اخیر تجارت جهانی روز به روز از سرعت بیشتر و حجم بیشتری برخوردار شده است. در این رابطه کشورها در تلاش هستند که خود را با آهنگ رشد تجارت جهانی هماهنگ نمایند و سهم خود را در تجارت جهانی افزایش دهند. بسیاری اعتقاد دارند کشورهایی که به روند و شتاب تجارت جهانی توجه ندارند، به لحاظ سهم کمترشان در صادرات جهانی و پایین بودن درآمد ارزی، نه تنها نمی‌توانند نیازهای وارداتی خود را تامین کنند بلکه از مسیر رشد و توسعه اقتصادی هم باز می‌مانند. درآمد صادراتی برای اغلب کشورها یک امر حیاتی محسوب می‌شود.

الگوی سنتی تجارت، بر اساس فرض رقابت کامل است. در این الگوها کشورهای مختلف به کشورهای بزرگ و کوچک تقسیم می‌شوند. کشورهای بزرگ می‌توانند بر قیمت های جهانی تاثیر گذارند. اما کشورهای کوچک پذیرنده قیمت هستند و نمی‌توانند بر قیمت های جهانی تاثیر بگذارند. تئوری های جدید تجارت بین الملل، بر شرایط رقابت ناقص بنا شده است و فرض می‌شود که بنگاه صادرکننده توانایی تعیین قیمت را دارد و با قیمت های جهانی ثابت روبرو نیست. با تغییر نرخ ارز بنگاه واکنش نشان داده و قیمت صادرات را تغییر می‌دهد. تغییر قیمت صادرات، تقاضای خارجی برای کالاهای صادراتی بنگاه را تغییر داده و در نتیجه صادرات تغییر می‌کند.

برای اقتصادهای در حال توسعه و بخصوص کشورهایی که استراتژی توسعه صادرات را دنبال می‌نمایند، بررسی میزان انتقال اثر نرخ ارز بر قیمت صادرات موضوعی مهم و حیاتی محسوب می‌شود. چرا که در این کشورها بایستی تغییرات نرخ ارز طوری تنظیم شود که رقابت پذیری آنها در بازارهای صادراتی را تضمین نماید.

از طریق بحث و بررسی انتقال نرخ ارز و قیمت کالاهای مبادله شده درجه رقابتی تعیین می‌شود و ضریب انتقال نرخ ارز تاثیر نرخ ارز را به عنوان ابزار برنامه ریزی توسعه صادرات و تعادل تراز پرداخت

ها نشان می‌دهد. در این رابطه منون^۵ (۱۹۹۵) و فریرا^۶ (۱۹۹۷) اذعان می‌کنند که در بررسی میزان انتقال اثر نرخ ارز این سیاست مورد بررسی قرار می‌گیرد که آیا کشور می‌تواند از طریق افزایش نرخ ارز میزان صادرات را افزایش دهد؟ هر چقدر میزان انتقال اثر افزایش نرخ ارز به سمت انتقال کامل گرایش داشته باشد، میزان کارایی این سیاست در برنامه توسعه صادرات کاهش می‌یابد.

از این رو با توجه به اهمیت میزان انتقال اثر نرخ ارز بر صادرات از کانال شاخص قیمت صادرات و در نتیجه اثر گذاری آن بر توسعه صادرات بررسی و تعیین تجربی میزان انتقال اثر نرخ ارز بر قیمت صادرات در ایران و شرکای تجاری منتخب به منظور توسعه صادرات یک ضرورت جدی است. با تعیین میزان انتقال اثر نرخ ارز بر صادرات در ایران و شرکای تجاری سیاست‌گذاران اقتصادی کشور می‌توانند ضمن تعیین سیاست‌های ارزی مناسب، در برنامه ریزی‌های توسعه صادرات سیاست‌ها و اقدامات مناسبی اتخاذ نمایند تا بدین ترتیب به اهداف مهم اقتصادی دست یابند.

در این مطالعه به بررسی انتقال نرخ ارز به شاخص قیمت صادرات برای کشورهای ایران و شرکای عمده تجاری آن با هدف پیش بینی میزان انتقال به شاخص صادرات این کشورها و نحوه واکنش این کشورها به افزایش نرخ ارز پرداخته شده است.

۱-۳-هدف

هدف این تحقیق تعیین و تحلیل تجربی میزان انتقال اثر نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات ایران و شرکای عمده تجاری منتخب در فاصله سال‌های ۱۹۷۵-۲۰۰۷ است.

۱-۴-سؤال تحقیق

میزان انتقال نرخ ارز بر قیمت صادرات در ایران و شرکای منتخب تجاری چگونه است؟

۱-۵-فرضیه تحقیق

میزان انتقال نرخ ارز بر قیمت صادرات در ایران و شرکای منتخب تجاری کمتر از واحد است.

⁵Menon

⁶Ferreira

۱-۶- جامعه آماری

مطالعه حاضر به لحاظ هدف از نوع کاربردی و به لحاظ روش تجزیه و تحلیل از نوع تحقیقات تحلیلی و توصیفی می‌باشد. آمار و اطلاعات مورد نیاز تحقیق از اطلاعات موجود در IFS و WDI 2010 و همچنین داده‌های سری زمانی بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران به روش اسنادی و کتابخانه‌ای جمع آوری شده‌است. جامعه آماری مورد مطالعه کشور ایران و شرکای عمده تجاری منتخب بوده‌است. شرکای منتخب شامل کشورهای انگلستان، ژاپن، هلند، اسپانیا و پاکستان می‌باشد. این پنج کشور از میان ۲۲ کشوری که طی سه سال اخیر یعنی سال‌های ۱۳۸۷ تا سال ۱۳۸۹ بیشترین سهم از کل ارزش مبادلات انجام شده با ایران را به خود اختصاص داده بودند و نیز دارای اطلاعات کامل مورد نیاز بوده‌است، انتخاب شده‌اند. داده‌های جمع آوری شده با استفاده از آمار توصیفی مورد بررسی قرار گرفته‌اند و به منظور آزمون فرضیه، مدل تجربی تحقیق که مبتنی بر مطالعات نظری و تجربی است، با استفاده از روش‌های اقتصادسنجی و به کمک نرم افزارهای Stata11 و Eviews6 تخمین زده شده و مورد تجزیه و تحلیل قرار گرفته‌است.

۱-۷- محدودیت‌های تحقیق

مهم‌ترین محدودیت تحقیق مربوط به داده‌های مورد نیاز تحقیق می‌باشد. با توجه به اینکه در بررسی میزان انتقال نرخ ارز به شاخص قیمت صادرات هرچه میزان داده‌ها و کشورها بیشتر باشد، نتایج از دقت بیشتری برخوردار خواهند بود، لذا عدم دسترسی به مشاهدات بیشتر یکی از محدودیت‌های اساسی این تحقیق می‌باشد و ممکن است اثرات انتقال نرخ ارز را به درستی نشان ندهد. در تحقیق حاضر برای این منظور سعی شده‌است از حداکثر بازه زمانی ممکن استفاده شود و همچنین حوزه مورد بررسی را به کشورهای با داده‌های کامل که جزو شرکای عمده تجاری ایران هم می‌باشند، محدود شود.

۱-۸- سازماندهی تحقیق

این تحقیق در ۶ فصل سازماندهی شده است. در ادامه در فصل دوم، مبانی نظری و مطالعات تجربی تحقیق مرور می شود. در فصل سوم، روند متغیرهای تحقیق به صورت کیفی بررسی می شود. فصل چهارم به معرفی روش شناسی تحقیق و مباحث اقتصادسنجی مورد استفاده در تحقیق اختصاص یافته است در فصل پنجم به برآورد مدل، تجزیه و تحلیل یافته ها پرداخته شده و خلاصه و نتیجه گیری و ارائه پیشنهادها در فصل ششم ارائه شده است.

فصل دوم:

مروری بر ادبیات موضوع

۲-۱- مقدمه

این فصل در دو قسمت کلی تنظیم گردیده است. بعد از مقدمه، در قسمت اول مبانی تئوریک در ارتباط با انتقال نرخ ارز بیان شده است. در ادامه به مروری بر مطالعات خارجی و داخلی صورت گرفته در زمینه انتقال نرخ ارز بر شاخص قیمت صادرات بررسی پرداخته شده است. در بخش آخر نیز جمع بندی فصل ارائه شده است.

۲-۲- مبانی نظری

گلدبرگ و کنتنر^۷ (۱۹۹۷) اشاره می کنند مطالعات اولیه در زمینه بحث انتقال نرخ ارز و از بحث انتقال اثر نرخ ارز بر قیمت واردات از دهه ۱۹۷۰ شروع شده است. اما بعدها محدوده این مطالعات به بررسی اثر نرخ ارز بر سطح قیمت تولیدات داخلی و صادرات بر حسب پول داخلی نیز گسترش یافت. در واقع ارتباط اساسی میان نرخ ارز و قیمت کالاهای تجاری بین المللی به طور عام به انتقال نرخ ارز معروف است که این مفهوم اولین بار توسط مگی^۸ (۱۹۷۳) توسعه یافته است. ولی در این ارتباط قابل ذکر است که اولین بار دورنبوش^۹ (۱۹۸۷) بطور دقیق و با استفاده از مدل به این موضوع پرداخته است؛ به عبارتی، مطالعه دورنبوش پایه گذار سایر مطالعات درباره نحوه انتقال تغییرات نرخ ارز بر قیمتها بوده است. وی در مطالعه خود رابطه نرخ ارز و قیمت های داخلی را بر حسب میزان تمرکز بازار، میزان واردات، جانشینی واردات و تولیدات داخلی مورد بررسی قرار داده است.

مدل ماندل-فلمینگ^{۱۰} نشان می دهد که برای یک اقتصاد کوچک افزایش ارزش پول ملی منجر به کاهش قدرت رقابت صادرات و افزایش واردات می شود. ابیسیگ و لین یوک^{۱۱} (۱۹۹۸). آتوکورالا^{۱۲} (۱۹۹۱) و آتوکورالا و منون^{۱۳} (۱۹۹۴) استدلال می کنند که با کنار گذاشتن فرض وجود بازار رقابت کامل، صادرکنندگان ممکن است به وسیله کاهش حاشیه سود^{۱۴} خود در مواجهه با افزایش ارزش پول

⁷Goldberg and Knetter

⁸Magee

⁹Dornbush

¹⁰Mundell (1963), Fleming (1962)

¹¹Abeyisighe and Lin Yeok

¹²Athukorala

¹³Athukorala and Menon

¹⁴Mark-up