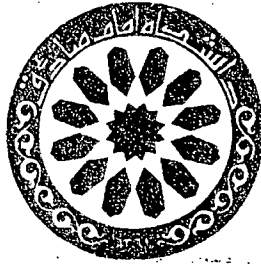


بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

۹۴۹۰۹

کتابخانه مرکزی دانشگاه امام صادق



دانشگاه امام صادق (علیه السلام)

دانشکده معارف اسلامی و اقتصاد

پایان نامه دوره کارشناسی ارشد معارف اسلامی و اقتصاد

برآورد کثرت ارزی و درآمدی تابع تقاضا برای واردات کل کشور

سلیمان قاسمیان

استاد راهنما:  
دکتر محمدرضا شاهرودی

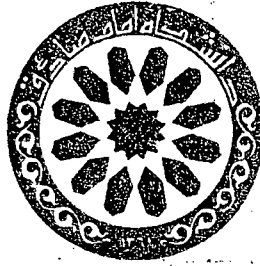
استاد مشاور:  
دکتر مهدی صادقی

۱۳۸۳ / ۱۲ / ۳۱

۶۶۶۰۰

پائیز ۱۳۸۰

کتابخانه مرکزی دانشگاه امام صادق (ع)



شماره ۱۹۰  
شماره ۴

دانشگاه امام صادق (علیه السلام)

دانشکده معارف اسلامی و اقتصاد

پایان نامه دوره کارشناسی ارشد معارف اسلامی و اقتصاد

برآورد کشتش ارزی و درآمدی تابع تقاضا برای واردات کل کشور

سلیمان قاسمیان

استاد راهنما:

دکتر محمدرضا شاهرودی

۱۳۸۳ / ۱۴ / ۳۶

از اطلاعات مرکز علمی ایران  
تیم مدیریت

پائیز ۱۳۸۰

۲۱

کلیه حقوق اعم از چاپ و تکثیر، نسخه برداری  
ترجمه، اقتباس و ... از این پایان نامه کارشناسی ارشد  
برای دانشگاه امام صادق علیه السلام محفوظ است.  
نقل مطالب با ذکر مأخذ بلامانع است.





## تأییدیه اعضای هیأت داوران حاضر در جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد

اعضای هیأت داوران نسخه نهایی پایان نامه آقای: سلیمان قاسمیان ۷۳۳۰۹۵۵۲۵

تحت عنوان: برآورد تابع تقاضا برای واردات کشور طی سالهای ۷۷ - ۱۳۳۸

..... *کشتی ازین روز آمدن* .....

را از نظر شکل و محتوی بررسی نموده و پذیرش آنرا برای تکمیل درجه کارشناسی ارشد پیوسته پیشنهاد می کنند.

اعضای هیأت داوران	نام و نام خانوادگی	رتبه علمی	محل امضاء
(۱) استاد راهنما:	دکتر محمدرضا شاهرودی	استادیار	
(۲) استاد مشاور:	دکتر مهدی صادقی	استادیار	
(۳) نماینده شورای تحصیلات تکمیلی دانشکده: دکتر مهدی صادقی		استادیار	
(۴) اساتید ناظر:			
(۱) آقای دکتر داود منظور		استادیار	
(۲) .....		.....	.....

## چکیده :

هدف اصلی از نگارش این پایان نامه ، برآورد کشش ارزی و درآمدی تقاضا برای واردات کل کشور به منظور مطالعه عوامل و متغیرهای موثر بر واردات کالا و خدمات طی دوره ۴۰ ساله ۷۷ - ۱۳۳۸ می باشد. مدل اصلی این تحقیق برگرفته از جدیدترین و موفق ترین مدل ارائه شده از سوی صندوق بین المللی پول برای کشورهای در حال توسعه می باشد. متغیرهای اصلی مدل مذکور شامل میزان درآمد ملی ( تولید ناخالص داخلی) ، نرخ واقعی ارز، شاخص ذخایر ارزی بین المللی و واردات دوره قبل می باشد. باتوجه به شرایط اقتصاد ایران، متغیرهای مجازی نظیر دوره اصلاحات تجاری ( ۷۲ - ۱۳۶۸) و دوره تحدید واردات پس از سال ۱۳۷۳ و نرخ تعرفه های گمرکی نیز به مدل افزوده شده است.

بررسی اثر سیاستهای غیرتعرفه ای نظیر آزاد سازی و سهمیه بندی ورود کالا که یکی از شاخص های میزان دخالت دولت در بخش واردات است، در قالب متغیرهای مجازی، تعیین میزان وقفه بهینه متغیرهای توضیحی مدل، استخراج توابع کوتاه مدت و بلندمدت تقاضا برای واردات کشور با کمک آخرین نرم افزارهای اقتصادسنجی از دیگر ویژگی های این تحقیق است.

نتایج این پژوهش حاکی از نقش قابل ملاحظه درآمد ملی بر تقاضا برای واردات در کل دوره مورد بررسی است. سیاستهای ارزی و نرخ واقعی ارز عمدتاً در سالهای پس از پیروزی انقلاب و شاخص ذخایر ارزی نیز در دوره قبل از انقلاب بر میزان تقاضای واردات کشور موثر بوده است.

## کلید واژه ها:

تقاضا برای واردات، تولید ناخالص داخلی، نرخ واقعی ارز، سیاستهای تعرفه ای، سیاستهای غیرتعرفه ای و

ذخایر ارزی بین المللی

دکتر شهبازی  
مهرماه  
۱۳۹۱

دراسة سياسات و الاستراتيجيات الاساسيه لايجاد شروط مناسبة لتنمية الصدور و رقابة الاستيراد و تحسين ميزان التجارية قد لفت نظر المحققين والباحثين منذ عهد بعيد. في هذا المجال، غالب البحوث قد استأثر بدراسة تأثير الصدور و قد وقع بدور الاستيراد موقع اهتمام قليل.

المطالعة والبحث حول العوامل و الاسباب المهمة المؤثرة في استيراد الاقلام والخدمات الملى في مدة اربعين سنة (٧٧ - ١٣٣٨). النموذج الاصلى لهذا البحث قد اخذ من احدث النماذج الموفقه التي ابرزت من جانب المحققين والباحثين صندوق بين الدولى للتعود. لحصول إلى النموذج الحقيقى والدقيق لطلب الاستيراد الملى مضافة إلى الاركان الاصليه لذلك النموذج التي تشمل دخل الملى (انتاج الداخلى الاجمالى)، سعر الحقيقى لعملة الصعبة، مؤشر الذخاير بين الدولى لعملة الصعبة، الاستيراد في سنة الماضيه، قد استفيد من عاملين مجازيين.

الغرض من هذا البحث، حصول الجواب المناسب لهذا السؤال الذى ما هو دور هذه العوامل خاصة سياسة غير التعرفه و تغييراته في تعيين ميزان الاستيراد الملى. في الحقيقه سياسات غير التعرفيه التي اتخذت من جانب الدوله مثل سياسة تحرير استيراد المواد و ممنوعيتها، من الشوائف الاصليه التي تبين ميزان مداخله الدوله في امور التجارية. في هذا البحث بعد تعيين ميزان الوقفه الحقيقيه والحسنى لعوامل الموضحه في النموذج المطروحه يستخرج توابع قصير المدة و طويل مدة لطلب الاستيراد الملى باستعانة بامج الاقتصاديه الكمبيوترية.

مع هذا التخمين يعرض علينا ان طلب الاستيراد يتأثر كثيرا من تغييرات الدخل الملى (انتاج الداخلى الاجمالى) يمكن توجيهه و قبول هذا الامر مع عناية الى دور المهم التي يلعب الدخل الحاصل من بيع النفط من كل انتاج الداخلى الاجمالى في تعيين الاستيراد. ضافه الى الدخل، الاستيراد في ادوار الماضيه الذى يبين اثر الثقافة المصرفى و ايضا يؤثر كثيرا في تنظيم الاستيراد الملى. في هذا المجال مرونة الكثيره لعوامل المجازيه مثل دورة الاصلاحات التجاريه و سنوات بعدها يشير الى الدور المهم سياسة غير تعرفه التجاريه المتخذة من جانب الدوله بعد ثورة الاسلاميه. في النهايه، نتيج البحث يدل على ان سياسة تغيير عملة الصعبة بعد ثورة الاسلاميه قد تأثر كثيرا في تعيين ميزان الاستيراد. مع ان مرونة ذخاير عملة الصعبة التي كان يؤثر اثرا مثبتا و ضعيفا على مسير الاستيراد ولكن اثرها كانت قويه في زمن قبل ثورة الاسلاميه.

طلب الاستيراد - سعر الحقيقى لعملة الصعبة - انتاج الداخلى الاجمالى - سياسات التعرض - سياسات

غير التعرفى - ذخاير بين الدولى - مرونة عملة الصعبة - مرونة الدخل

فصل اول: مبانی نظری.....	۸
۱-۱ نظریات مختلف تجارت بین الملل.....	۹
۱-۱-۱ دیدگاه سوداگران.....	۹
۲-۱-۱ دیدگاه کلاسیکها.....	۱۰
۳-۱-۱ تئوری نئوکلاسیکها.....	۱۱
۴-۱-۱ منتقدان نظریه تجارت آزاد.....	۱۲
۵-۱-۱ سیاستهای جدید تجارت بین الملل.....	۱۴
۱-۵-۱-۱ سیاست جانشینى واردات.....	۱۴
۲-۵-۱-۱ سیاستهای صادرات گرا.....	۱۸
۲-۱ عوامل مؤثر بر تقاضای واردات.....	۲۰
۱-۲-۱ درآمد ملی.....	۲۱
۱-۱-۲-۱ تأثیر مثبت افزایش درآمد بر واردات.....	۲۱
۲-۱-۲-۱ تأثیر منفی افزایش درآمد بر واردات.....	۲۲
۲-۲-۱ قیمت‌های نسبی.....	۲۴
۱-۲-۲-۱ روش رابطه مبادله.....	۲۴
۲-۲-۲-۱ روش حساسیت‌ها.....	۲۶
۳-۲-۱ تعرفه‌های گمرکی.....	۲۹
۱-۳-۲-۱ آثار اقتصادی تعرفه‌های گمرکی.....	۲۹



۳۰	..... حالت تعادل جزئی ۱-۱-۳-۲-۱
۳۱	..... حالت تعادل کلی ۲-۱-۳-۲-۱
۳۵	..... نرخ ارز ۴-۲-۱
۳۶	..... کشش عرضه ارزهای خارجی ۱-۴-۲-۱
۳۸	..... کشش تقاضای ارزهای خارجی ۲-۴-۲-۱
۳۹	..... ذخایر ارزی بین‌المللی ۵-۲-۱
۴۲	..... فصل دوم: مطالعات انجام شده در زمینه تقاضا برای واردات
۴۳	..... ۱-۲ مطالعات انجام شده در خارج
۴۳	..... ۱-۱-۲ مدل هوتاگر - مگی
۴۴	..... ۲-۱-۲ مدل همفیل
۴۵	..... ۳-۱-۲ مدل محسن خان
۴۷	..... ۴-۱-۲ مدل خواجه سرمد
۴۸	..... ۵-۱-۲ مدل موران
۴۹	..... ۶-۱-۲ مدل فیروز وکیل و حسین رضوی
۵۱	..... ۷-۱-۲ مدل پسران
۵۱	..... ۲-۲ مطالعات انجام شده در داخل
۵۱	..... ۱-۲-۲ مدل بهمن اسکویی
۵۳	..... ۲-۲-۲ مدل مسعود نیلی
۵۴	..... ۳-۲-۲ سایر مدلها

فصل سوم: بررسی روند واردات کشور و عوامل مؤثر بر آن	۵۸
۱-۳ سیاستها و روند واردات کشور در دوره قبل از انقلاب اسلامی	۵۹
۱-۱-۳ روند واردات کشور طی سالهای ۱۳۲۰-۳۲	۵۹
۲-۱-۳ سیاست بازرگانی دروازه‌های باز در سالهای ۱۳۳۲-۳۹	۶۰
۳-۱-۳ روند واردات کشور طی سالهای ۱۳۳۹-۴۲ (در دوران تثبیت اقتصادی)	۶۱
۴-۱-۳ سیاستها و روند واردات در سالهای اجرای برنامه‌های عمرانی سوم و چهارم کشور (۱۳۴۲-۵۱)	۶۲
۵-۱-۳ روند واردات کشور طی سالهای ۱۳۵۲-۵۷	۶۴
۲-۳ سیاستهای بازرگانی و روند واردات در سالهای بعد از انقلاب اسلامی	۶۶
۱-۲-۳ سیاستهای بازرگانی در سالهای ۱۳۵۸-۶۷	۶۶
۱-۱-۲-۳ تشکیل مراکز تهیه و توزیع	۶۶
۲-۱-۲-۳ بررسی سیاستهای ارزی در سالهای ۱۳۵۷-۶۷	۶۷
۳-۱-۲-۳ بررسی سیاستهای تعرفه‌ای و غیرتعرفه‌ای طی سالهای ۱۳۵۷-۶۷	۶۸
۲-۲-۳ سیاستهای واردات طی سالهای ۱۳۶۸-۷۲	۷۲
۱-۲-۲-۳ سهم واردات در تولید ناخالص داخلی و ترکیب آن	۷۶
۲-۲-۳ بررسی سیاستهای واردات در دوره ۱۳۷۳-۷۷	۷۸
۱-۳-۲-۳ سیاستهای ارزی در دوره ۱۳۷۳-۷۷	۷۹
۲-۳-۲-۳ سیاستهای تعرفه‌ای و شبه تعرفه‌ای در سالهای ۱۳۷۳-۷۷	۸۱
۳-۳-۲-۳ تحلیل روند واردات طی دوره زمانی ۱۳۷۳-۷۷	۸۳
۱-۳-۲-۲-۳ سهم واردات از تولید ناخالص داخلی و ترکیب آن	۸۵

فصل چهارم: تخمین تابع تقاضا برای واردات کل کشور.....	۸۷
۱-۴ معرفی مدل و روش انجام تحقیق.....	۸۸
۲-۴ نگاه اجمالی به مباحث اقتصادسنجی جدید.....	۹۲
۱-۲-۴ آشنایی با مفاهیم اولیه.....	۹۲
۱-۱-۲-۴ فراگرد تصادفی.....	۹۲
۲-۱-۴-۲ نوفه سفید.....	۹۲
۳-۱-۲-۴ جمع‌شدگی.....	۹۳
۲-۲-۴ مانایی و نامانایی.....	۹۳
۳-۲-۴ آزمونهای مانایی.....	۹۵
۱-۳-۲-۴ آزمون تابع خود همبستگی.....	۹۵
۲-۳-۲-۴ همبستگی نگار.....	۹۵
۳-۳-۲-۴ آزمونهای لجانگ باکس و باکس پیرس.....	۹۵
۴-۳-۲-۴ آزمون ریشه واحد.....	۹۵
۱-۴-۳-۲-۴ آزمون دیکی فولر.....	۹۵
۲-۴-۳-۲-۴ آزمون دیکی فولر تعمیم یافته.....	۹۵
۵-۳-۲-۴ آزمون ریشه واحد پرون.....	۹۵
۴-۲-۴ مفهوم همگرایی و تعریف آن.....	۹۶
۱-۴-۲-۴ آزمون انگل و گرنجر.....	۹۷
۲-۴-۲-۴ آزمون همگرایی جوهانسن.....	۹۸
۳-۴ برآورد مدل لاهیری، مونتیل و ندیم‌الحق (LMN).....	۹۸

۴-۴	بررسی اثر متغیرهای مجازی در مدل تقاضا برای واردات (LMN) .....	۹۹
۵-۴	بررسی اثر مجموع عوارض گمرکی و نرخ سود بازرگانی بر تقاضا برای واردات ...	۱۰۱
۶-۴	بررسی مانایی متغیرها و استخراج مدل کوتاه‌مدت تقاضا برای واردات (ECM) .	۱۰۲
۱۰۴	ضمیمه فصل چهارم: آزمون فرضی کلاسیک مدل نهایی .....	۱۰۴
۱۰۷	فصل پنجم: خلاصه و نتیجه‌گیری .....	۱۰۷
۱۴۰	ضمائم .....	۱۴۰
۱۱۲	فهرست منابع .....	۱۱۲

## مقدمه:

در دنیای کنونی یکی از مهمترین مباحث اقتصادی که تمام کشورها به آن توجه دارند، تقویت بازرگانی خارجی و بهبود کسری تجاری می‌باشد. همه دولت‌ها در برنامه‌های اقتصادی خود سعی دارند تا وضعیت تراز تجاری خود را بهبود بخشیده و با اجرای سیاست‌های حساب شده سهم خود را در بازرگانی بین‌الملل را افزایش دهند. به منظور نظارت دقیق و برنامه‌ریزی هدفمند برای بخش بازرگانی، در اولین قدم باید عوامل مؤثر بر هر یک از بخش‌های واردات و صادرات مشخص گردند. در این تحقیق سعی شده است تا با بررسی دقیق سیاست‌های بازرگانی اتخاذ شده از سوی دولت، روند واردات کشور طی دوره ۴۰ ساله، ۷۷-۱۳۳۸ مورد ارزیابی قرار گرفته و سیاست‌های ارزی و سایر عوامل مؤثر بر واردات کشور نظیر میزان درآمد ملی و میزان تأثیرگذاری آنها در تقاضا برای واردات تعیین گردند. بدین ترتیب امکان برنامه‌ریزی دقیق و پیش‌بینی‌های قابل قبول برای واردات کشور و دستیابی به اهداف کوتاه‌مدت و بلندمدت محقق می‌گردد.

طی این دوره ۴۰ ساله که نیمی از آن قبل و نیم دیگر بعد از پیروزی انقلاب اسلامی می‌باشد، عوامل متعددی در تعیین واردات کشور نقش داشته‌اند. برخی از این عوامل جزء عوامل شناخته شده و مطابق با مبانی نظری اقتصادی متداول بوده و برخی دیگر خاص شرایط اقتصادی - سیاسی کشورمان می‌باشد که از آن جمله می‌توان به اثر شوک نفتی دهه ۵۰، پیروزی انقلاب اسلامی، دوره جنگ تحمیلی و دوره اصلاحات تجاری بعد از آن اشاره کرد.

در این پایان‌نامه با بررسی اثر تک تک این عوامل بر واردات، مدل نهایی واردات کشور که بیشترین قابلیت توضیح دهندگی را دارد، ارائه می‌گردد. این تحقیق از ۵ فصل تشکیل گردیده است. در فصل اول مبانی نظری موجود در زمینه تقاضا برای واردات در ادبیات اقتصادی متداول بیان گردیده است. در فصل دوم که با عنوان مطالعات انجام شده در زمینه

تقاضا برای واردات می‌باشد، تمامی بررسی‌های انجام شده در این زمینه که برای کشورهای مختلف توسعه یافته و در حال توسعه صورت پذیرفته است، ارائه می‌شود. در فصل سوم به سیاستهای بازرگانی اتخاذ شده طی سالهای قبل و بعد از انقلاب و نقش آن در تقاضای واردات کشور پرداخته شده است.

فصل چهارم پایان‌نامه به تخمین تابع تقاضا برای واردات کل کشور اختصاص دارد که در این قسمت ضمن معرفی مدل، روش انجام تحقیق بیان می‌گردد. با توجه به اینکه تابع تقاضا برای واردات بر اساس روشهای اقتصادسنجی جدید برآورد می‌گردد در این فصل ابتدا بطور اجمالی به مباحث اقتصادسنجی جدید اشاره شده است.

فصل پنجم نیز شامل خلاصه و نتیجه‌گیری از مطالب ارائه شده و ارائه پیشنهادات می‌باشد.

در پایان وظیفه خود می‌دانم که از زحمات بی‌شائبه همه اساتید محترم دانشکده معارف اسلامی و اقتصاد خصوصاً جناب آقای دکتر محمدرضا شاهرودی و جناب آقای دکتر مهدی صادقی که در تمام مراحل تحصیل و نگارشی پایان‌نامه مرا راهنمایی نمودند تقدیر و تشکر نمایم. همچنین از جناب آقای دکتر داود منظور که داوری پایان‌نامه اینجانب را تقبل فرمودند و مرا از نظرات سازنده خود آگاه ساختند سپاسگذاری می‌نمایم.

## کلیات

### (۱) بیان مسأله

در ادبیات اقتصادی، مدل تقاضای واردات شاهد تحولات نظری نسبتاً گسترده‌ای بوده است. در ابتدا اعتقاد بر این بود که تقاضای واردات در کشورهای در حال توسعه بوسیله نیروهای غیر بازار تعیین می‌شود. اما مطالعات متعدد در سه دهه اخیر نشان داد که نظریه مذکور درست نمی‌باشد. مدل‌های اولیه، تقاضای واردات را تابعی از درآمد ملی کشور وارد کننده، قیمت‌های نسبی و در برخی موارد نظیر مدل هوتا کر - مگی و مدل محسن خان تابعی از میزان واردات دوره‌های قبل ( $Mt-1$ ) نیز می‌دانند. ویلیام همفیل در بررسی تقاضای واردات کشورهای در حال توسعه با انتقاد از نظریات قبلی به دلیل عدم توجه به وجود محدودیتهای بازرگانی و ارزی، واردات کشورهای در حال توسعه را تابعی از دریافتهای ارزی و ذخایر ارزی بین‌المللی می‌داند. کریستین موران نیز مانند همفیل در مدل خود بر محدودیتهای ارزی تأکید داشته و آنرا هزینه‌هایی که بر اقتصاد کشور تحمیل می‌شود، می‌داند.

مدلی که در این پایان‌نامه برای تخمین تابع تقاضای واردات بکار رفته است، مدلی است که توسط سه تن از کارشناسان صندوق بین‌المللی پول بنامهای ندیم‌الحق، لاهیری و مونتیل در سال ۱۹۹۰ برای کشورهای در حال توسعه ارائه شده است. این مدل برای ۳۱ کشور در حال توسعه مورد آزمون قرار گرفته و نتایج آن حاکی از معنادار بودن مدل و درجه توضیح دهندگی بالای تقاضای واردات در این کشورها بوده است. در مدل تقاضای واردات که به صورت لگاریتمی می‌باشد، متغیرهای مستقل عبارتند از:

(۱) نرخ ارز واقعی (۲) درآمد ملی (۳) شاخص ذخایر ارزی بین‌المللی (۴) واردات دوره قبل

$$\text{Log}M_t = a + a_1 \text{Log}(E_t \cdot P_{ft}/P_t) + a_2 \text{Log}Y_t + a_3 \text{Log}(R_{t-1}/P_{ft-1} \cdot M_{t-1}) + a_4 \text{Log}M_{t-1}$$

در مدل فوق،  $E_t$ ،  $P_{ft}$ ،  $P_t$ ، به ترتیب نرخ ارزی رسمی، شاخص قیمت کالاها و خدمات