

## دانشگاه الزهرا

### دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی

پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته توسعه اقتصادی و برنامه ریزی

#### عنوان:

بررسی عوامل تعیین کننده جریانهای تجاری با تاکید بر بخش صنعت

استاد راهنما: جناب آقای دکتر احمد یزدان پناه

استاد مشاور: سرکار خانم دکتر زهرا افشاری

دانشجو: بیتا نوروزی

اسفند ۱۳۷۷

#### چکیده:

در این پایان نامه ضمن بررسی عوامل تعیین کننده جریانهای تجاری ایران به پاسخگویی و آزمون فرضیه های زیر پرداخته می شود:

۱- عرضه صادرات غیر نفتی و صادرات صنعتی و همچنین تقاضای کل وادرات مواد اولیه و واسطه ای و سرمایه ای بخش صنعت و معدن در مقابل قیمت‌های نسبی کشش پذیر هستند.

۲- صادرات غیر نفتی و صنعتی نسبت به موجودی سرمایه و تغییرات آن کشش پذیر هستند .

۳- رابطه معنا داری بین واردات کالاهای واسطه ای و سرمایه ای بخش صنعت و معدن و درآمدهای ارزی حاصل از صادرات نفت و گاز وجود.

دوره تحت بررسی سالهای ۱۳۳۸ تا ۱۳۷۵ بوده و تکنیک مورد استفاده ,آزمون ایستایی دیکی فولر,

آزمون همگرایی انگل و گرنجر , آزمون حداکثر در ستمیابی و مدل تصحیح خطا میباشد.

نتایج حاصل از بررسیها نشان میدهد که تاثیر تغییرات قیمت‌های داخلی بر عرضه صادرات غیر نفتی و صادرات صنعتی بیش از اثر تغییرات قیمت‌های صادراتی می باشد و نشان می دهد که ساختار تقاضای داخلی اثر قابل توجهی بر عرضه صادرات غیر نفتی (بویژه صادرات صنعتی) دارد. در دوره مورد بررسی رابطه مثبتی بین صادرات غیر نفتی و موجودی سرمایه وجود داشته است بدین معنی که افزایش موجودی سرمایه منجر به افزایش صادرات غیر نفتی شده است اما این رابطه چندان قوی نمیباشد. در مدل تصحیح خطای صادرات غیر نفتی ضریب جمله پسماند با وقفه نشان می دهد که تعادل از هر دوره به دوره بعد به اندازه ۳۹٪ تعدیل می شود و بیانگر سرعت تصحیح خطا نسبت به مسیر بلند مدت است. همچنین تقاضای واردات کل و واردات سرمایه ای بخش صنعت و معدن در مقابل قیمت‌های نسبی از کشش کمتر از یک برخوردار است. بنابراین با افزایش قیمت‌های نسبی نمی توان بر حجم واردات تاثیر زیادی گذاشت، در عوض واردات مواد اولیه و واسطه ای بخش صنعت و معدن در مقابل قیمت‌های نسبی کشش بزرگتر از واحد دارد. حساسیت واردات در مقابل در یافتیهای ارزی حاصل از صادرات نفت و گاز نزدیک به یک می باشد و نشان می دهد که محدودیت ارزی از عوامل مهمی است که روی تقاضای واردات اثر می گذارد. در مدل تصحیح خطای واردات کل، ضریب جمله پسماند با وقفه نشان می دهد که عدم تعادل از هر دوره به دوره بعد به اندازه ۳۳٪ تعدیل میگیرد و بیانگر سرعت تصحیح خطا نسبت به مسیر بلند مدت است. با توجه به نتایج بدست آمده از تخمین مدل، در نهایت پیشنهاداتی ارائه شده است.

## فهرست مطالب

### فصل اول: کلیات

۱-۱- پیشگفتار

۱-۲- مقدمه

۱-۳- متدولوژی تحقیق

## فصل دوم: بررسی تجارت خارجی ایران

### ۲-۱- اهمیت تجارت جهانی

۲-۱-۱- بررسی وضع موجود ساختار تجارت جهانی و ایران

۲-۲- صادرات، تحولات و وضعیت موجود

۲-۲- واردات، تحولات و وضعیت موجود

## فصل سوم: مبانی تئوریک

۳-۱- بحث تئوری توابع عرضه و تقاضای واردات

۳-۱-۱- تخمین تابع تقاضای واردات و صادرات

۳-۱-۲- تشخیص تابع تقاضای واردات و صادرات

۳-۱-۳- فرم تابع

۳-۱-۴- واکنش وقفه ها

۳-۱-۵- مشکلات خاص در تخمین

۳-۲- بحث تئوریک کششها

۳-۲-۱- کششهای مهم

۳-۲-۲- اثر تغییرات قیمت روی صادرات و واردات

## فصل چهارم: مروری بر مطالعات انجام شده

## فصل پنجم: برآورد توابع عرضه صادرات و تقاضای واردات

۵-۱- بررسی توابع

۵-۱-۱- هدف از بررسی

- ۲-۱-۵-روش تخمین
- ۳-۱-۵-اطلاعات آماری
- ۲-۵-بر آورد معادلات
- ۱-۲-۵-عرضه صادرات غیر نفتی
- ۱-۱-۲-۵-تخمین مدل به روش OLS
- ۲-۱-۲-۵-آزمون ریشه واحد
- ۳-۲-۲-۵-آزمون همگرایی انگل و گرنجر
- ۴-۱-۲-۵-روش برآورد حداکثر در ستنمایی (LM)
- ۵-۱-۲-۵-تخمین مدل تصحیح خطا
- ۲-۲-۵-عرضه صادرات صنعتی
- ۱-۲-۲-۵-تخمین مدل به روش ols
- ۳-۲-۵-تقاضای واردات کل
- ۱-۳-۲-۵-تخمین مدل به روش OLS
- ۲-۳-۲-۵-آزمون ریشه واحد
- ۳-۳-۲-۵-آزمون همگرایی انگل و گرنجر
- ۴-۳-۲-۵-روش برآورد حداکثر در ستنمایی (LM)
- ۵-۳-۲-۵-تخمین مدل تصحیح خطا
- ۴-۲-۵-تقاضای واردات مواد اولیه و واسطه ای بخش و معدن
- ۱-۴-۲-۵-تخمین مدل به روش OLS
- ۵-۲-۵-تقاضای واردات مواد اولیه و واسطه ای بخش صنعت و معدن
- ۱-۵-۲-۵-تخمین مدل به روش OLS
- ۳-۵-تفسیر ضرائب

ضمیمه فصل پنجم

فصل ششم: نتیجه گیری و ارائه پیشنهادات

۶-۱- نتیجه گیری

۶-۲- پیشنهادات

فهرست منابع

ضمائم کامپیوتری

جداول آماری