

نرخ ارز و اثر تغییرات آن بر صادرات غیر نفتی در اقتصاد ایران

نرخ ارز به عنوان یکی از مهمترین و مؤثرترین متغیرهای اقتصاد کلان می باشد. نرخ ارز به عنوان قیمت یک واحد پول خارجی بر حسب واحدهای پول داخلی تاثیر مهمی بر متغیرهای کلان اقتصادی همچون تولید، صادرات، تراز پرداختها و غیره دارد. در اقتصاد کشور ما از یک طرف دولت انحصار درآمدهای ارزی و در نتیجه قیمت گذاری هر واحد ارز را در اختیار دارد و از سوی دیگر بدلیل وابستگی اقتصاد به این درآمدها، میزان منابع ارزی و نرخ تعیین شده برای آن از طریق تاثیر آن بر عرضه و تقاضای کل بر متغیرهای اقتصادی تاثیر می گذارد.

برای مثال، طی سالهای 84-1381 به طور متوسط حجم درآمدهای ارزی کشور سالانه معادل (۴۱.۵) میلیارد دلار و سهم درآمدهای ارزی حاصل از فروش نفت و گاز به طور متوسط (۳۳.۸) میلیارد دلار، که معادل ۶۲ درصد کل درآمدهای ارزی بوده است. این نقش دولت هم برای سال های قبل از یکسان سازی نرخ ارز (۱۳۸۱) با مشخص کردن نرخ هایی تحت عنوان صادرات نفتی و صادرات غیر نفتی، و پس از آن تاکنون با تعیین نرخ بازار بین بانکی تداوم داشته است. نرخ اخیر از سال ۱۳۸۱ تاکنون از سوی بانک مرکزی تعیین و در یک دامنه بسیار محدود توسط سیستم بانکی عمل می شود.

نوسانات گسترده و وسیع نرخ ارز می تواند نتایج مثبت و منفی در پی داشته باشد که یکی از این عواقب می تواند تورم های بسیار شدید و لجام گسیخته باشد و این موضوع نیز خود پیامدهای گسترده دیگری در اقتصاد خواهد داشت. تغییر بافت های تولیدی و سرمایه گذاری، تغییر وضعیت

بازارهای داخلی و خارجی، تحت تأثیر قرار گرفتن بخش تجارت خارجی (صادرات و واردات) همه می توانند از این عواقب بی شمار باشند. از طرف دیگر بدلیل وجود ارتباط ساختاری بین همه متغیرهای کلان اقتصادی تغییرات نرخ ارز می تواند از طرق مختلف سطح قیمت ها، تولید و صادرات را متأثر سازد. در این گفتار سعی شده که تأثیر حاصل از تغییرات نرخ ارز بر صادرات غیر نفتی مورد بررسی قرار گیرد. از آنجا که تولید و سطح قیمت ها نیز بر سطح صادرات غیر نفتی موثر است. بنا براین بررسی اثر تغییر نرخ ارز بر سطح عمومی قیمت ها (تورم) و سطح تولید کل نیز ضروری است.

صادرات نفتی بعنوان بخش اعظمی از صادرات اقتصاد کشور مستقل از تغییرات نرخ ارز می باشد. اما صادرات غیر نفتی با تأثیر پذیری از تغییرات نرخ ارز و برخی متغیرهای کلان دیگر نوسانات و تغییرات را تجربه کرده است. لذا تعیین سطح نرخ اسمی ارز و نحوه تأثیر گذاری آن بر متغیرهای کلان اقتصادی همچون صادرات غیر نفتی، تولید و تورم در کشور ما همواره مورد اختلاف نظر سیاست گذاران و صاحب نظران اقتصادی بوده و یکی از مهمترین چالش های موجود در عرصه سیاست گذاری اقتصاد کشور محسوب می شود. با توجه به مبانی نظری موجود در اقتصاد کلان نرخ ارز بر صادرات غیرنفتی و تورم تأثیر مستقیم و مثبت و بر تولید کل تأثیر منفی دارد. یعنی صادرات غیر نفتی و تورم به طور مستقیم با افزایش نرخ ارز افزایش می یابد و افزایش نرخ ارز تولید کل را مقید می کند. (کالاهای واسطه ای و سرمایه ای که تقریباً ۸۵ درصد واردات کشور ما را تشکیل می دهند وابسته بودن اقتصاد تولید به واردات را بیان می کند.)

طبق تئوری های اقتصادی، صادرات غیر نفتی علاوه بر نرخ ارز، تابعی مستقیم از سطح تولید کل و تابع معکوسی از سطح عمومی قیمت ها می باشد. (البته متغیرهای دیگری غیر از پارامترهای اشاره شده بر صادرات غیر نفتی موثرند که اشاره به آنها در مجال تحلیل نمی باشد). لذا تغییرات نرخ ارز

اثرات مستقیم و غیر مستقیم بر صادرات غیر نفتی خواهد داشت. مطالعات اقتصادسنجی در راستای تئوری های اقتصادی نشان داده است که افزایش نرخ ارز به طور مستقیم موجب افزایش صادرات غیر نفتی می شود. اما با توجه به ویژگیهای اقتصاد کشور ما تاثیرات غیر مستقیم این افزایش بر صادرات غیر نفتی در جهت کاهش صادرات غیر نفتی بوده است. این نتایج با تئوری های اقتصادی سازگار است. مثلاً افزایش نرخ ارز منجر به افزایش سطح عمومی قیمت ها شده و قدرت رقابت کالاهای

تولید داخل را در بازارهای بین المللی کاهش می دهد. این در حالی است که تورم در کشورهای طرف تجاری ایران که عمده مبادلات تجاری را با این کشورها داریم، تقریباً مقداری ناچیز و ثابت است. امارات متحده عربی، عراق، هندوستان، چین، ژاپن، آذربایجان، آلمان، ایتالیا، اسپانیا و انگلستان و اکثر کشورهای عضو OECD در چند سال اخیر با سهم بالایی طرف های تجاری ایران محسوب می شوند. نرخ تورم این کشورها در سال 2007 و 2006 به ترتیب در جدول الف آمده است.

جدول، نرخ تورم برخی از کشورهای طرف تجاری ایران در سالهای 2006 و 2007

کشور	امارات عربی	ترکیه	هندوستان	چین	ژاپن	اندونزی	گدان	ایتالیا	اسپانیا	انگلستان	ترانس
2006	5/5	6/5	4/8	2	0/3	1/8	1/8	2/5	3/4	1/9	1/7
2007	5	4/4	4/9	2/1	0/4	1/7	2/5	2/1	3/1	1/9	1/8

لذا افزایش نرخ ارز منجر به افزایش سطح عمومی قیمت ها شده و از طریق این متغیر صادرات غیر نفتی را کاهش می دهد و این از اثرات غیرمستقیم افزایش نرخ ارز بر صادرات غیر نفتی است که متأسفانه در برخی از تحلیل ها نادیده گرفته می شود.

از طرف دیگر از آنجا که طی سال های اخیر سهم بالایی از واردات کشور را واردات کالاهای سرمایه ای و واسطه ای تشکیل می دهد، ( طی سال های ۱۳۸۲ تا ۱۳۸۳ بیش از ۷۸ درصد واردات کشور را واردات کالاهای سرمایه ای و واسطه ای تشکیل می دهد). لذا افزایش نرخ ارز موجب گران شدن این کالاها برای اقتصاد داخلی شده و این امر در نهایت منجر به کاهش توان تولید یا افزایش هزینه های تولید داخل می گردد و می تواند سطح عمومی قیمت های داخلی را افزایش دهد و صادرات این کالاها را با مشکل روبرو کند.

این اثر نیز از دیگر اثرات منفی غیر مستقیم افزایش نرخ ارز بر صادرات غیر نفتی می باشد. برخی از سیاست گزاران اقتصادی کشور با استناد به روند صادرات غیر نفتی در چند سال اخیر و بعد از سال ۱۳۸۱ که یکسان سازی نرخ ارز اتفاق افتاد، تاکید دارند افزایش نرخ ارز منجر به افزایش صادرات غیر نفتی شده است. اما با نگاهی به ترکیب صادرات غیر نفتی در سالهای یاد شده می توان پی برد که در چند سال اخیر ۳ تا ۵ میلیارد دلار از صادرات غیر نفتی را صادرات محصولات پتروشیمی تشکیل داده است که تولید این کالاها اساساً وابستگی چندانی به نرخ ارز ندارند.

نتایج مطالعات در ارتباط با این موضوع در اقتصاد ایران حاکی از آن است که مجموع اثرات غیر مستقیم از اثرات مستقیم بیشتر بوده و افزایش نرخ ارز در اقتصاد ایران سیاست مناسبی برای بالا بردن سطح صادرات غیر نفتی نمی باشد. لذا بهتر است قبل از تصمیم گیری در مورد نرخ ارز و تغییرات آن، ترکیب کالاهای صادراتی و وارداتی، کشش آنها، شاخص قیمت کالاهای داخلی و کشورهای خارجی طرف مقابل، اثرات این تغییرات بر سایر متغیرهای کلان و اثرات متقابل آنها بر همدیگر مورد بررسی قرار گیرد.