

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشگاه آزاد اسلامی

واحد خمینی شهر

دانشکده علوم انسانی ، گروه اقتصاد

پایان نامه برای دریافت درجه کارشناسی ارشد

گرایش اقتصاد - توسعه اقتصادی و برنامه‌ریزی

عنوان:

تاثیر نرخ واقعی ارز بر اشتغال کشورهای منتخب اسلامی

استاد راهنما:

دکتر حسین کریمی هسینیجه

استاد مشاور:

دکتر همایون رنجبر

نگارش:

مژگان اسدی

تابستان ۱۳۸۸



دانشگاه آزاد اسلامی

واحد خمینی شهر

دانشکده علوم انسانی ، گروه اقتصاد

پایان نامه برای دریافت درجه کارشناسی ارشد M.A

گرایش توسعه اقتصادی و برنامه‌ریزی

عنوان:

تأثیر نرخ واقعی ارز بر اشتغال کشورهای منتخب اسلامی

نگارش:

مژگان اسدی

تابستان ۱۳۸۸

در تاریخ .../.../.... توسط کمیته تخصصی زیر مورد بررسی و تصویب نهائی قرار گرفت.

دکتر حسین کریمی هسینجه

۱-استاد راهنمای پایان نامه

دکتر همایون رنجبر

۲-استاد مشاور پایان نامه

دکتر فرزاد کریمی

۳-استاد داور

دکتر میرمحمدصادقی

۴-استاد داور

دکتر مصطفی رجبی

مدیر تحصیلات تکمیلی گروه اقتصاد

کلیه حقوق مادی مرتبط بر نتایج مطالعات،
ابتکارات و نوآوریهای ناشی از تحقیق
موضوع این پایان نامه متعلق به دانشگاه آزاد
اسلامی واحد خمینی شهر است.

تشکر و قدردانی

جناب آقای دکتر حسین کریمی هسنیجه ،استاد راهنمای بزرگوارم که با صبر و حوصله آنچه را که می دانستند در اختیار اینجانب قرار داده اند.

جناب آقای دکتر همایون رنجبر، استاد مشاور که با اشرافی عالمانه همیشه پاسخگوی مشکلات و سختی ها و سئوالهای بجا و نابجای اینجانب بوده اند.

علاوه بر این، وظیفه خود می دانم از پدر و مادر عزیزم و همچنین همسرم که همواره در طول دوران تحصیل، با راهنمایی ها و کمک های معنوی خویش مشوق من بوده اند، تقدیر و تشکر کنم. و در پایان از دوستان عزیزم، خانم مژده افصحی ،راضیه حاتمی، آقای محمدرضا مبشری به خاطر مساعدت های ویژه در انجام رساله تشکر ارزنده دارم.

تقدیم به :

پدرو مادر عزیزم که در راه تحصیل من
از هیچ کمکی دریغ نکردند و این راه
پرمشقت را بر من هموار ساختند و در
تمامی مراحل تحصیل مشوق من بوده اند و
من با هیچ زبانی قادر به سپاسگذاری از
زحمات آنان نیستم و تقدیم به همسر مهربانم
که دریای صبر و محبت است و مهر او
گرمابخش زندگانی ام می باشد .

فهرست مطالب

<u>صفحه</u>	<u>عنوان</u>
..... أ	فهرست مطالب
..... و	فهرست جداول
..... ز	چکیده

فصل اول: کلیات

..... ۲	۱-۱- مقدمه
..... ۳	۱-۲- بیان مسأله
..... ۵	۱-۳- اهمیت تحقیق
..... ۶	۱-۴- اهداف پژوهش
..... ۶	۱-۵- فرضیه های پژوهش
..... ۷	۱-۶- کاربرد نتایج
..... ۷	۱-۷- روش تحقیق
..... ۸	۱-۸- داده ها
..... ۸	۱-۹- کلید واژه ها
..... ۸	۱-۹-۱- نرخ واقعی ارز
..... ۸	۱-۹-۲- اشتغال
..... ۹	۱-۹-۳- داده های تابلویی

۹-۹-۴- کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی ۹

۱۰-۱- خلاصه فصل ۹

فصل دوم: ادبیات موضوع و پیشینه تحقیق

۱-۲- مقدمه ۱۱

۲-۲- نرخ ارز ۱۲

۱-۲-۲- نرخ رسمی و غیررسمی ارز ۱۳

۲-۲-۲- نرخ اسمی و واقعی ارز ۱۳

۳-۲- نوسانات نرخ ارز ۱۴

۱-۳-۲- روند نرخ ارز واقعی ۱۵

۴-۲- اهمیت اقتصادی نرخ ارز ۱۶

۵-۲- تاثیر نرخ ارز واقعی بر تعدادی از متغیرهای کلان اقتصادی ۱۷

۶-۲- تحلیل اثرگذاری نرخ ارز واقعی بر اشتغال ۲۰

۱-۶-۲- کانال تکنولوژی ۲۰

۲-۶-۲- کانال صادرات ۲۲

۳-۶-۲- کانال کارایی ۲۴

۷-۲- سیاستهای نرخ ارز در ایران ۲۵

۸-۲- وضعیت اشتغال در اقتصاد ایران ۲۶

۱-۸-۲- موانع زیر ساختی اشتغال در ایران ۲۷

۲-۹- سازمان کنفرانس اسلامی ۲۸

۲-۱۰- مروری بر مطالعات گذشته ۳۰

۲-۱۰-۱- مطالعات داخلی ۳۰

۲-۱۰-۲- مطالعات خارجی ۴۰

۲-۱۱- خلاصه فصل ۴۸

فصل سوم : روش تحقیق

۳-۱- مقدمه ۵۰

۳-۲- روش تحلیل ۵۰

۳-۲-۱- داده های تابلویی ۵۶

۳-۳-۲- روش ترکیبی OLS (پولینگ) ۵۹

۳-۲-۱-۱- مزایای استفاده از روش داده های تابلویی ۶۰

۳-۳-۳- انواع داده های تابلویی ۶۲

۳-۳-۱- اثرات ثابت ۶۲

۳-۳-۲- اثرات تصادفی ۶۴

۳-۴-۳- آزمون های تشخیصی ۶۵

۳-۴-۱- آزمون مانایی ۶۶

۳-۴-۲- آزمون F لیمر ۶۷

۳-۴-۳- آزمون هاسمن ۶۹

۷۱..... ۴-۴-۳-آزمون بروش - پاگان

۷۲..... ۵-۳-جمع بندی و نتیجه گیری فصل

فصل چهارم: تجزیه و تحلیل داده ها و نتایج

۷۴..... ۱-۴-مقدمه

۷۴..... ۲-۴-متغیرهای به کار رفته در مدل و نحوه استخراج آنها

۷۴..... ۱-۲-۴-تولید داخلی

۷۵..... ۲-۲-۴-صادرات

۷۵..... ۳-۲-۴-نرخ ارز واقعی

۷۶..... ۴-۲-۴-سرمایه گذاری مستقیم خارجی

۷۶..... ۵-۲-۴-سرمایه

۷۷..... ۶-۲-۴-اشتغال

۷۷..... ۳-۴-منابع آماری متغیرها

۷۷..... ۴-۴-جامعه آماری تحقیق، دلایل انتخاب

۷۸..... ۵-۴-روش برآورد و تحلیل نتایج آن

۷۹..... ۱-۵-۴-نتایج آزمون های تشخیصی

۷۹..... ۲-۵-۴-نتایج آزمون مانایی - هادری

۸۰..... ۳-۵-۴-نتایج آزمون f لیمر

۸۰ ۴-۵-۴-نتایج آزمون هاسمن
۸۰ ۴-۵-۵-نتایج آزمون بروش پاگان
۸۳ ۴-۷-خلاصه فصل

فصل پنجم : نتیجه گیری و پیشنهادات

۸۵ ۵-۱-مقدمه
۸۶ ۵-۲- جمع بندی و نتایج تحقیق
۸۶ ۵-۳- آزمون فرضیه ها
۸۷ ۵-۳-۱- آزمون فرضیه اول
۸۷ ۵-۳-۲- آزمون فرضیه دوم
۸۷ ۵-۳-۳- آزمون فرضیه سوم
۸۸ ۵-۳-۴- آزمون فرضیه چهارم
۸۸ ۵-۴-محدودیت های تحقیق
۸۹ ۵-۵-پیشنهادات
۸۹ ۵-۵-۱- پیشنهادات مربوط به نتایج تحقیق
۹۰ ۵-۵-۲-پیشنهادات مربوط به مطالعات آینده
۹۱ ۵-۶- جمع بندی فصل
۹۳ منابع و ماخذ
۱۰۱ ضمائم

فهرست جداول

<u>صفحه</u>	<u>عنوان</u>
۴۲.....	۱-۱- جدول (۱-۲): نتایج برآورد الگو.....
۷۸.....	۲-۱- جدول (۱-۴): کشورهای منتخب اسلامی.....
۷۹.....	۳-۱- جدول (۲-۴): آزمون هادری برای متغیرهای سری زمانی.....
۸۲.....	۴-۱- جدول (۳-۴): نتایج برآورد الگو به روش اثرات تصادفی.....
۱۰۱.....	۵-۱- جدول آزمون مانایی متغیرهای مدل.....

چکیده

نظر به اهمیت سیاست های ارزی در اقتصاد و اثراتی که نرخ ارز بر روابط خارجی، داخلی و اوضاع اقتصادی از جمله تولید و اشتغال در کشورها دارد، در این پژوهش، اثر نرخ واقعی ارز و کانال های تاثیرگذار آن بر اشتغال بررسی می گردد. نرخ واقعی ارز از طریق سه کانال شامل تغییرات سرمایه به تغییرات نیروی کار (کانال تکنولوژی)، صادرات (کانال میزان صادرات) و تأکید بر بهبود کارایی (کانال کارایی) بر اشتغال اثر می گذارد.

برآورد نرخ ارز واقعی بر اشتغال با بررسی تابع تقاضای نیروی کار شروع می شود سپس این مدل با در نظر گرفتن متغیرهای تولید داخلی، میزان صادرات، حجم سرمایه، سرمایه گذاری مستقیم خارجی و نرخ واقعی ارز بسط می یابد. تابع تقاضای نیروی کار بسط داده شده با استفاده از داده های تابلویی در کشورهای منتخب اسلامی طی دوره های ۱۹۹۵ تا ۲۰۰۵ برآورد می شود.

تحلیل های اقتصادی با روش اقتصاد سنجی نشان می دهد که نرخ ارز واقعی، تاثیر مثبت و معنی داری بر اشتغال دارد.

کلید واژه: نرخ ارز واقعی - اشتغال - داده های تابلویی - کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی