

بِسْمِ اللّٰهِ الرَّحْمٰنِ الرَّحِیْمِ



وزارت علوم، تحقیقات و فناوری  
پژوهشگاه علوم انسانی و مطالعات فرهنگی  
مدیریت تحصیلات تکمیلی  
پژوهشکده اقتصاد

پایان نامه کارشناسی ارشد رشته علوم اقتصادی

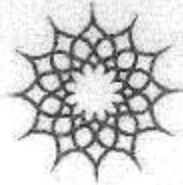
**تعیین کننده‌های تورم در ایران با تأکید بر تورم وارداتی**

استاد راهنما  
دکتر ابراهیم التجائی

استاد مشاور  
دکتر سید محمدرضا امیری طهرانی

پژوهشگر  
نیلوفر ابراهیمی

اسفند ماه ۱۳۹۲



وزارت علوم، تحقیقات و فناوری  
پژوهشگاه علوم انسانی و مطالعات فرهنگی  
مدیریت تحصیلات تکمیلی

باسمه تعالی

هیأت داوران در جلسه مورخ ۱۳۹۲/۱۲/۲۵

پایان نامه تحصیلی خانم نیلوفر ابراهیمی دانشجوی مقطع کارشناسی ارشد

رشته علوم اقتصادی

تحت عنوان :

تعیین کننده های تورم در ایران با تاکید بر تورم وارداتی

را بررسی کردند و پایان نامه با درجه خوب به تصویب نهایی رسید.

۱. استاد راهنمای پایان نامه، آقای دکتر ابراهیم التجائی با مرتبه علمی استادیار

۲. استاد مشاور پایان نامه، آقای دکتر سید محمد رضا امیری طهرانی زاده با مرتبه علمی استادیار امضا

۳. استاد داور پایان نامه، آقای دکتر امیر محمدی نژاد با مرتبه علمی استادیار

امضا

امضا

امضای رئیس پژوهشگاه

امضای مدیر گروه

امضای نماینده مدیریت تحصیلات تکمیلی

## سپاس خداوندیکتارا که هر چه دارم از اوست

خداوند مهربان را سپاسگزارم که این توفیق را به من عنایت فرمود تا با به سرانجام رساندن این تحقیق، قطره‌ای در  
اقیانوس بیکران علم و دانش قرار گیرم.

از زحمات بی دریغ استاد ارجمندم جناب آقای دکتر ابراهیم التجائی که به عنوان استاد راهنما در مکارش این پایان  
نامه، اینجانب را از علم و دانش خود بهره‌مند ساختند کمال تقدیر و تشکر را دارم. همچنین از استاد بزرگوارم جناب  
آقای دکتر محمد رضا امیری طهرانی که به عنوان استاد مشاور، نکات ارزنده‌ای را در مکارش این پایان نامه به بنده  
آموختند بسیار سپاسگزارم.

در پایان نیز از پدر و مادر عزیز و بزرگوارم، همسر مهربان و فدای کارم و برادر عزیزم که در تمام دوران زندگی به معنای واقعی  
کلمه حامی اینجانب بودند کمال تشکر را دارم.

نیلوفر ابراهیمی

اسفندماه ۱۳۹۲

تقدیم به

پدر بزرگوارم

مادر عزیزم

همسر مهربانم

که موفقیت‌های خود را مرهون فداکاری‌های آنان می‌دانم.

## چکیده:

تورم از جمله پدیده‌های مضر اقتصادی است که اثرات زیان‌باری بر کل اقتصاد یک کشور بر جای می‌گذارد. اهمیت موضوع تورم و نتایج آن بر اقتصاد جامعه موجب شده است که پژوهش‌های بسیاری در این زمینه صورت پذیرد. در این پایان‌نامه علاوه بر مطالعه‌ی عوامل مؤثر بر تورم، نقش تورم وارداتی در تورم ایران و همچنین عوامل تعیین‌کننده‌ی تورم وارداتی را نیز مورد بررسی قرار دادیم. برای این منظور با استفاده از الگوهای خودرگرسیون برداری غیر مقید و ساختاری و داده‌های فصلی مربوط به دوره‌ی ۱۳۸۲-۱۳۹۱ به بررسی اثر متغیرهای رشد حجم پول، رشد مخارج دولت، رشد نرخ ارز و تورم کشورهای طرف تجاری بر تورم پرداخته‌ایم. نتایج نشان دهنده‌ی آن است که تمام متغیرهای یاد شده بر تورم تأثیرگذارند. تا قبل از سال ۱۳۹۰ و افزایش ناگهانی نرخ ارز متغیر نرخ تورم بیشتر تحت تأثیر تکانه‌های خود قرار دارد اما بعد از این سال نرخ ارز بیشترین نقش را در توضیح تغییرات نرخ تورم ایفا می‌کند. همچنین بر اساس یافته‌های تحقیق، تا قبل از سال ۱۳۹۰ نقش تورم کشورهای طرف تجاری در توضیح تورم وارداتی بیشتر است اما بعد از این سال نرخ ارز عامل اصلی تورم وارداتی می‌باشد. همچنین رشد مخارج دولت در کوتاه‌مدت و رشد حجم پول در بلندمدت تأثیرگذارتر می‌باشند.

واژگان کلیدی: تورم، تورم وارداتی، حجم پول، مخارج دولت، نرخ ارز، الگوی خودرگرسیون برداری ساختاری

## پیشگفتار:

تورم<sup>۱</sup> همواره یکی از مهم‌ترین پدیده‌های اقتصادی و موضوعات مورد مطالعه‌ی اقتصاددانان بوده است. در حال حاضر این پدیده یکی از دغدغه‌های اصلی اقتصاددانان و سیاست‌مداران کشور به حساب می‌آید. نرخ تورم در سال‌های اخیر روند فزاینده‌ای را به دنبال داشته به طوری که این نرخ از ۱۵/۶ درصد در سال ۱۳۸۲ به ۳۰/۵ درصد در سال ۱۳۹۱ رسیده است. وجود نرخ تورم بالا در کشور (به خصوص در سال‌های اخیر) موجب شد که در این تحقیق به مطالعه‌ی عوامل مؤثر بر تورم ایران طی سال‌های ۱۳۸۲-۱۳۹۱ پرداخته شود.

مطالعات زیادی در زمینه‌ی عوامل مؤثر بر تورم ایران صورت گرفته و دلایل زیادی برای تورم شناسایی شده است. حجم بالای نقدینگی، کسری بودجه، وابستگی به درآمدهای نفتی، عدم استقلال بانک مرکزی، شکاف تولید ناخالص داخلی، تورم انتظاری، افزایش نرخ ارز و ... از جمله دلایلی بودند که توسط بسیاری از محققان در دوره‌های مختلف مورد بررسی قرار گرفتند. تورم وارداتی<sup>۲</sup> از جمله دلایلی است که در سال‌های اخیر بسیار مورد توجه واقع شده است. از سال ۱۳۸۲ به بعد با مقررات زدایی گسترده و کوشش‌های مربوط به تسهیل جریان تجارت خارجی، واردات در ایران روند فزاینده‌ای داشته است. هرچند در بعضی مطالعات صورت گرفته در زمینه‌ی دلایل تورم در اقتصاد ایران به تورم وارداتی نیز پرداخته شده اما در هیچ‌یک از این مطالعات دلیل ایجاد تورم وارداتی مورد بررسی قرار نگرفته است. بنابراین در این تحقیق علاوه بر این که به بررسی عوامل مؤثر بر تورم ایران پرداخته می‌شود، نقش تورم وارداتی در تورم ایران و دلایل ایجاد آن نیز مورد تأکید قرار گرفته است.

---

<sup>۱</sup> . Inflation

<sup>۲</sup> . Import Inflation

## فهرست مطالب

فصل اول: کلیات تحقیق.....	۸
۱.۱. مقدمه.....	۹
۲.۱. مسأله پژوهش.....	۱۰
۳.۱. قلمرو پژوهش.....	۱۱
۴.۱. اهمیت و ضرورت انجام این پژوهش.....	۱۲
۵.۱. اهداف پژوهش.....	۱۲
۶.۱. سؤالات پژوهش.....	۱۲
۷.۱. فرضیه‌های پژوهش.....	۱۳
۸.۱. روش پژوهش و تجزیه و تحلیل اطلاعات.....	۱۳
۹.۱. روش گردآوری اطلاعات.....	۱۳
۱۰.۱. محدودیت‌ها.....	۱۳
۱۱.۱. سازماندهی تحقیق.....	۱۴
فصل دوم: ادبیات و مبانی نظری تحقیق.....	۱۵
۱.۲. مقدمه.....	۱۶
۲.۲. تعریف واژه‌های مهم و کلیدی.....	۱۶
۳.۲. انواع تورم.....	۱۹
۱.۳.۲. انواع تورم بر اساس شدت و ضعف.....	۱۹



- ۲۰..... ۲.۳.۲. انواع تورم بر مبنای نسبت افزایش قیمت‌ها به افزایش حجم پول.....
- ۲۰..... ۳.۳.۲. انواع تورم بر مبنای متناوب یا عارضه‌ای بودن افزایش قیمت‌ها.....
- ۲۱..... ۴.۳.۲. انواع تورم بر حسب رابطه‌ی افزایش قیمت‌ها با سطح تولید.....
- ۲۱..... ۴.۲. نظریه‌های اقتصادی در خصوص دلایل تورم.....
- ۲۲..... ۱.۴.۲. تورم ناشی از فشار تقاضا.....
- ۲۲..... ۱.۱.۴.۲. نظریه‌ی مقداری پول.....
- ۲۵..... ۲.۱.۴.۲. مکتب پولی (پولیون).....
- ۲۶..... ۳.۱.۴.۲. الگوی شکاف تورمی کینز.....
- ۲۷..... ۲.۴.۲. تورم ناشی از فشار هزینه.....
- ۲۸..... ۳.۴.۲. تورم ناشی از عوامل ساختاری.....
- ۲۹..... ۴.۴.۲. تورم انتظاری.....
- ۳۰..... ۵.۴.۲. تورم وارداتی.....
- ۳۰..... ۱.۵.۴.۲. تورم کشورهای طرف معامله.....
- ۳۱..... ۲.۵.۴.۲. نرخ ارز.....
- ۳۴..... ۵.۲. آسیب شناسی تورم.....
- ۳۴..... ۱.۵.۲. آثار تورم از نظر توزیع درآمدها.....
- ۳۴..... ۲.۵.۲. آثار تورم بر پس‌انداز و فعالیت‌های اقتصادی.....
- ۳۴..... ۳.۵.۲. آثار تورم بر مصرف.....
- ۳۵..... ۴.۵.۲. اثرات تورم بر توزیع منابع و کارایی.....
- ۳۵..... ۵.۵.۲. آثار تورم از نظر ایجاد ابهام و عدم اطمینان در تصمیم‌گیری‌های اقتصادی.....
- ۳۶..... ۶.۲. جمع‌بندی و نتیجه‌گیری.....

فصل سوم: مروری بر مطالعات پیشین.....	۳۸
۱.۳. مقدمه.....	۳۹
۲.۳. مطالعات صورت گرفته‌ی خارجی.....	۳۹
۳.۳. مطالعات صورت گرفته‌ی داخلی.....	۴۶
۴.۳. جمع‌بندی و نتیجه‌گیری.....	۵۷
فصل چهارم: مروری بر روند تورم و سایر متغیرهای مدل در ایران.....	۶۰
۱.۴. مقدمه.....	۶۱
۲.۴. روند تورم در ایران (۱۳۸۲-۱۳۹۱).....	۶۱
۳.۴. بررسی روند نقدینگی در ایران.....	۶۳
۴.۴. بررسی روند نرخ ارز در ایران.....	۶۵
۵.۴. بررسی روند واردات در ایران.....	۶۷
۶.۴. معرفی کشورهای طرف تجاری ایران و بررسی نرخ تورم کشورهای طرف تجاری.....	۶۷
۷.۴. بررسی روند مخارج دولت.....	۶۸
۸.۴. جمع‌بندی.....	۷۰
فصل پنجم: تفسیر الگوهای اقتصادسنجی و تخمین مدل.....	۷۱
۱.۵. مقدمه.....	۷۲
۲.۵. مدل‌های VAR و SVAR.....	۷۳
۳.۵. روش شناسی مدل SVAR.....	۷۵
۴.۵. مسئله تشخیص در مدل SVAR.....	۷۹
۵.۵. چه مواقعی می‌توان از مدل SVAR استفاده کرد؟.....	۸۱
۶.۵. معایب و اشکالات وارد به روش SVAR.....	۸۱
۷.۵. مزیت‌های استفاده از روش SVAR.....	۸۳

۸۴	۸.۵. معرفی مدل تحقیق.....
۸۴	۱.۸.۵. معرفی متغیرهای مدل.....
۸۵	۲.۸.۵. بررسی روند فصلی متغیرها.....
۸۷	۳.۸.۵. آزمون ریشه واحد برای بررسی مانایی متغیرهای تحقیق.....
۸۷	۱.۳.۸.۵. آزمون دیکی - فولر تعمیم یافته.....
۸۸	۲.۳.۸.۵. آزمون فیلیپس - پرون.....
۸۸	۴.۸.۵. انتخاب طول وقفه‌ها.....
۸۹	۹.۵. تصریح مدل VAR.....
۹۰	۱۰.۵. تحلیل نتایج توابع عکس‌العمل آنی در مدل VAR (۱۳۸۲-۱۳۹۱).....
۹۴	۱۱.۵. تحلیل نتایج تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی در مدل VAR (۱۳۸۲-۱۳۹۱).....
۹۵	۱۲.۵. تصریح و تخمین مدل SVAR.....
۹۷	۱۳.۵. تحلیل توابع واکنش آنی مدل SVAR (۱۳۸۲-۱۳۹۱).....
۱۰۰	۱۴.۵. تحلیل نتایج تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی در مدل SVAR (۱۳۸۲-۱۳۹۱).....
۱۰۲	۱۵.۵. تحلیل توابع واکنش آنی مدل VAR (۱۳۸۲-۱۳۸۹).....
۱۰۶	۱۶.۵. تحلیل نتایج تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی در مدل VAR (۱۳۸۲-۱۳۸۹).....
۱۰۷	۱۷.۵. تحلیل توابع واکنش آنی مدل SVAR (۱۳۸۲-۱۳۸۹).....
۱۱۰	۱۸.۵. تحلیل نتایج تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی در مدل SVAR (۱۳۸۲-۱۳۸۹).....
۱۱۱	۱۹.۵. جمع‌بندی.....
۱۱۳	فصل ششم: جمع‌بندی، نتیجه‌گیری و توصیه‌های سیاستی.....
۱۱۴	۱.۶. جمع‌بندی و نتیجه‌گیری.....
۱۱۷	۲.۶. توصیه‌های سیاستی.....
۱۱۸	کتاب‌نامه (منابع و مأخذ).....

فهرست جدول‌ها:

جدول ۱-۳ خلاصه‌ی مطالعات خارجی.....	۵۷
جدول ۲-۳ خلاصه‌ی مطالعات داخلی.....	۵۸
جدول ۱-۵ نتایج آزمون دیکی - فولر تعمیم یافته.....	۸۷
جدول ۲-۵ نتایج آزمون فیلیپس - پرون.....	۸۸
جدول ۳-۵ انتخاب وقفه بهینه.....	۸۹
جدول ۴-۵ تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی تورم در مدل VAR (۱۳۸۲-۱۳۹۱).....	۹۵
جدول ۵-۵ تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی تورم در مدل، SVAR (۸۲-۹۱).....	۱۰۰
جدول ۶-۵ تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی تورم در مدل، VAR (۸۲-۸۹).....	۱۰۶
جدول ۷-۵ تجزیه واریانس خطای پیش‌بینی در مدل، SVAR (۸۲-۸۹).....	۱۱۰

فهرست نمودارها:

- نمودار ۱-۴ رشد سالانه تورم ..... ۶۳
- نمودار ۲-۴ رشد فصلی تورم ..... ۶۳
- نمودار ۳-۴ رشد سالانه نقدینگی ..... ۶۵
- نمودار ۴-۴ رشد فصلی نقدینگی ..... ۶۵
- نمودار ۵-۴ رشد فصلی نرخ ارز ..... ۶۶
- نمودار ۶-۴ رشد سالانه نرخ ارز ..... ۶۶
- نمودار ۷-۴ رشد سالانه واردات ..... ۶۷
- نمودار ۸-۴ تورم کشورهای طرف تجاری ..... ۶۸
- نمودار ۹-۴ رشد سالانه پرداخت‌های هزینه‌ای و تملک دارایی‌های سرمایه‌ای دولت ..... ۶۹
- نمودار ۱۰-۴ رشد فصلی مخارج دولت ..... ۶۹
- نمودار ۵-۱ تابع خود همبستگی و خود همبستگی جزئی متغیر رشد مخارج دولت ..... ۸۶
- نمودار ۵-۲ تابع خود همبستگی و خود همبستگی جزئی متغیر رشد حجم پول ..... ۸۶
- نمودار ۵-۳ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک افزایش تورم، VAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۱
- نمودار ۵-۴ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک افزایش رشد حجم پول، VAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۱
- نمودار ۵-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک افزایش رشد مخارج دولت، VAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۲
- نمودار ۵-۶ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک افزایش رشد نرخ ارز، VAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۳
- نمودار ۵-۷ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک افزایش تورم کشورهای طرف تجاری، VAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۳
- نمودار ۵-۸ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک تورم، SVAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۷
- نمودار ۵-۹ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک رشد حجم پول، SVAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۸
- نمودار ۵-۱۰ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک مخارج دولت، SVAR (۸۲-۹۱) ..... ۹۹

- ۹۹.....(۸۲-۹۱)SVAR، تورم نسبت به شوک نرخ ارز، نمودار ۱۱-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک نرخ ارز،
- ۱۰۰.....(۸۲-۹۱)SVAR، تورم نسبت به شوک تورم کشورهای طرف تجاری، نمودار ۱۲-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک تورم کشورهای طرف تجاری،
- ۱۰۱.....شکست ساختاری نرخ ارز، نمودار ۱۳-۵
- ۱۰۲.....(۸۲-۸۹) VAR، تورم نسبت به شوک تورم، نمودار ۱۴-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک تورم،
- ۱۰۳.....(۸۲-۸۹) VAR، رشد حجم پول، نمودار ۱۵-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک رشد حجم پول،
- ۱۰۴.....(۸۲-۸۹) VAR، رشد مخارج دولت، نمودار ۱۶-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک رشد مخارج دولت،
- ۱۰۵.....(۸۲-۸۹) VAR، تورم نسبت به شوک نرخ ارز، نمودار ۱۷-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک نرخ ارز،
- ۱۰۵.....(۸۲-۸۹) VAR، تورم نسبت به شوک تورم کشورهای طرف تجاری، نمودار ۱۸-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک تورم کشورهای طرف تجاری،
- ۱۰۷.....(۸۲-۸۹)SVAR، تورم نسبت به شوک تورم، نمودار ۱۹-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک تورم،
- ۱۰۸.....(۸۲-۸۹)SVAR، رشد حجم پول، نمودار ۲۰-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک رشد حجم پول،
- ۱۰۸.....(۸۲-۸۹)SVAR، تورم نسبت به شوک مخارج دولت، نمودار ۲۱-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک مخارج دولت،
- ۱۰۹.....(۸۲-۸۹)SVAR، تورم نسبت به شوک نرخ ارز، نمودار ۲۲-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک نرخ ارز،
- ۱۱۰.....(۸۲-۸۹)SVAR، تورم نسبت به شوک تورم کشورهای طرف تجاری، نمودار ۲۳-۵ تابع واکنش آنی تورم نسبت به شوک تورم کشورهای طرف تجاری،

# فصل اول: کلیات تحقیق

## ۱.۱. مقدمه:

اهمیت ثبات قیمت‌ها در توسعه‌ی اقتصادی کشورهای در حال توسعه به گونه‌ای است که مورد توجه عده‌ی زیادی از برنامه‌ریزان و سیاست‌گذاران اقتصادی قرار گرفته و علت این امر آن است که تورم در این کشورها تهدیدی جدی علیه سیستم سیاسی و اقتصادی تلقی می‌شود. تورم موجب عدم تعادل در توزیع درآمد، تشدید فقر و بی‌عدالتی اجتماعی می‌شود، ریسک سرمایه‌گذاری را افزایش می‌دهد، از این رو بستر مناسب برای شکل‌گیری عدم اطمینان در نظام اقتصادی را فراهم می‌آورد. در این شرایط سرمایه‌گذاری به نفع فعالیت‌های سوداگرانه، که بازدهی سریع دارند، تغییر یافته و به تخصیص غیر کارآمد منابع منجر می‌شود.

مشکلی که در زمینه تورم وجود دارد بدین قرار است که بر خلاف توافق بر تعریف تورم، دیدگاه واحدی درباره علل ایجاد آن وجود ندارد. در ایران نیز با افزایش تورم در کشور و نارضایتی عمومی از آن در سال‌های اخیر تحلیل‌های مختلف و گاه متضادی درباره‌ی منشأ تورم و دلایل آن ارایه شده است. در بسیاری از این مطالعات بر جنبه‌ی پولی بودن تورم در اقتصاد ایران تأکید شده است و در مطالعات دیگر علاوه بر نقش پول در تورم ایران عوامل دیگری مانند انتظارات تورمی، کسری بودجه و مخارج دولت، شکاف تولید ناخالص داخلی، نرخ ارز و غیره مورد بررسی قرار گرفته است. نظرات ارایه شده در مورد منشأ خارجی تورم، که با تأکید و حمایت مسؤولان دولتی همراه بوده، تحلیل دیگری است که بازتاب‌های گسترده‌ای را در کشور به دنبال داشته است. منظور از منشأ خارجی تورم همان تورم وارداتی است، که از دو کانال قابل بررسی می‌باشد: یکی از طریق تورم موجود در طرف‌های تجاری یک کشور و دیگری از طریق نرخ ارز.



به هر حال اولین قدم در مبارزه با تورم شناسایی عوامل مؤثر بر آن می‌باشد. بنابراین در این مطالعه با استفاده از الگوهای خودرگرسیون برداری و خود رگرسیون برداری ساختاری<sup>۱</sup>، ضمن بررسی نقش رشد حجم پول و رشد مخارج دولت، به مطالعه‌ی نقش تورم وارداتی و کانال اصلی ورود آن بر تورم کشور پرداخته می‌شود، برای این منظور از دو متغیر رشد نرخ ارز و تورم کشورهای طرف تجاری ایران استفاده شده است.

در این فصل از تحقیق با مسأله‌ی پژوهش، قلمرو پژوهش، اهمیت و ضرورت، اهداف، سؤالات و فرضیه‌های پژوهش، روش پژوهش و تجزیه و تحلیل اطلاعات، روش گردآوری اطلاعات و محدودیت‌های تحقیق آشنا می‌شویم تا بتوان در فصل‌های آینده با توجه به مطالب عنوان شده در این فصل به بررسی فرضیات تحقیق پرداخته و پاسخی مناسب برای سؤالات آن بیابیم.

### ۲.۱. مسأله پژوهش:

تورم، افزایش مداوم در سطح عمومی قیمت‌ها و یا کاهش مستمر قدرت خرید پول، یکی از حادترین مشکلات در برخی کشورهای در حال توسعه می‌باشد که با وجود پیشینه طولانی تحلیل و بررسی همچنان مورد بحث است و جزء دغدغه‌های اصلی سیاستمداران و اقتصاددانان به شمار می‌رود. این دغدغه‌ی ذهنی اقتصاددانان، جوانب مختلف موضوع از علل تأثیرگذار بر تورم تا آثار تورم بر اقتصاد را در بر می‌گیرد. به هر حال به دلیل اهمیت موضوع تورم بررسی علل تورم از اهمیت ویژه‌ای برخوردار است، یکی از این علل‌ها تورم وارداتی است که در سال‌های اخیر بسیار مورد توجه سیاستمداران قرار گرفته است.

تورم وارداتی را می‌توان تورم ناشی از افزایش قیمت‌های جهانی و همچنین افزایش نرخ ارز دانست که در کشورهایی که به شدت وابسته به واردات هستند بیشتر بروز می‌کند. با توجه به این نکته که ایران کشوری است که اقتصاد آن به شدت وابسته به واردات است، تغییرات قیمت‌های جهانی و همچنین افزایش نرخ ارز نقش مهمی در تورم آن ایفا می‌کند.

به لحاظ نظری دلایل محکمی مبنی بر تأثیر تورم وارداتی بر تورم یک کشور وجود دارد. برای توضیح این اثرات، می‌توانیم تورم وارداتی را به دو صورت زیر در نظر بگیریم:

---

<sup>1</sup> . Structural Vector Auto Regressive(SVAR)

**الف)** تورم وارداتی به مفهوم سرایت و انتقال تورم حاکم بر اقتصاد سایر کشورها (اقتصاد جهانی) به اقتصاد داخلی یک کشور از طریق تجارت خارجی، شدت این نوع تورم بیشتر در کشورهایی مشاهده می‌شود که به واردات اتکای زیادی دارند.

**ب)** تورم وارداتی ناشی از کاهش ارزش پول ملی در برابر ارزهای دیگر: ارزش پول ملی ممکن است به دلایل مختلف سقوط کند. یکی از این دلایل می‌تواند پیدایش کسری تراز پرداخت‌ها باشد. در این صورت، قیمت کالاهای وارداتی - به ویژه مواد اولیه - افزایش می‌یابد. از طرف دیگر به واسطه کاهش ارزش پول ملی، کالاهای تولیدی داخلی برای خارجیان ارزان تمام خواهد شد به همین دلیل میزان صادرات کشور افزایش خواهد یافت و در نتیجه، امکان پیدایش کمبود کالا و نایابی آن به وجود خواهد آمد و قیمت‌های داخلی هم ترقی خواهد کرد.

در صورت پیدایش مازاد تراز پرداخت‌ها نیز - در کشورهای در حال توسعه - به احتمال زیاد قسمت عمده‌ی اضافه دریافتی، به شکل قدرت خرید اضافی، در بازار ظاهر می‌شود و قیمت‌ها را افزایش می‌دهد. زیرا تمایل به مصرف در این کشورها بسیار بالاست.

بنابراین با توجه به اهمیت مسأله تورم در کشور و نقش تورم وارداتی در آن، در این تحقیق به بررسی تعیین‌کننده‌های تورم در ایران با تأکید بر تورم وارداتی پرداخته می‌شود. برای بررسی اثر تورم وارداتی دو عامل تورم کشورهای طرف‌های تجاری ایران و همچنین نرخ ارز مورد ارزیابی قرار می‌گیرد. در این تحقیق با توجه به این که نرخ تورم کشورهای طرف تجاری برای اقتصاد ایران برون‌زا است، برای تجزیه و تحلیل داده‌ها از روش‌هایی استفاده می‌شود که بتوان این مسئله را لحاظ نمود.

### **۳.۱. قلمرو پژوهش:**

الف) قلمرو مکانی: ایران

ب) قلمرو زمانی: داده‌های فصلی سال‌های ۱۳۹۱-۱۳۸۲

ج) قلمرو موضوعی: اقتصاد کلان

#### ۴.۱. اهمیت و ضرورت انجام این پژوهش:

مطالعه تورم و عوامل تعیین کننده آن نقش مهمی در تعیین سیاست‌های اقتصادی برای مهار این پدیده مخرب دارد. با توجه به اینکه ایران به عنوان یک کشور در حال توسعه، به شدت وابسته به واردات است، بررسی تورم وارداتی در آن ضروری به نظر می‌رسد.

امارات، چین، جمهوری کره، ترکیه، سوئیس، آلمان، هلند، روسیه، هند، ایتالیا، ده کشوری هستند که بیشترین کالا و خدمات را به ایران صادر می‌کنند<sup>۱</sup>. یکی از عوامل تأثیر گذار بر تورم وارداتی می‌تواند تورم کشورهای طرف تجاری باشد که در سال‌های اخیر مورد تأیید بعضی از دولت‌مردان قرار گرفته است.

اما یکی دیگر از عوامل تورم وارداتی نرخ ارز است که در سال‌های اخیر به شدت رو به افزایش بوده است. افزایش نرخ ارز موجب بالا رفتن قیمت‌های کالاهای وارداتی و ایجاد تورم می‌شود.

بنابراین ضروری است تا یک بار به این پرسش پاسخ داده شود که آیا تورم ایران تحت تأثیر تورم وارداتی هست یا نه و اگر هست کدام تعریف از تورم وارداتی، تورم داخلی ایران را بیشتر متأثر می‌سازد؟

#### ۵.۱. اهداف پژوهش:

الف) تعیین عوامل مؤثر بر تورم ایران

ب) تبیین اهمیت نسبی تورم ناشی از نرخ ارز و تورم کشورهای طرف تجاری ایران

#### ۶.۱. سؤالات پژوهش:

با توجه به اهداف ذکر شده، در طول پژوهش سعی شده است که پاسخی روشن و مناسب برای سه سؤال زیر بیابیم:

۱. چه عواملی بر تورم ایران تأثیرگذار هستند؟

۲. نرخ ارز چه تأثیری بر تورم ایران می‌گذارد؟

۳. اثر تورم طرف‌های تجاری بر تورم ایران چگونه است؟

---

<sup>۱</sup> . آمار گمرک جمهوری اسلامی ایران.

## ۷.۱. فرضیه‌های پژوهش:

۱. رشد حجم پول، رشد مخارج دولت و تورم وارداتی عوامل تعیین کننده تورم در اقتصاد ایران می‌باشند.

۲. افزایش نرخ ارز رابطه‌ی مستقیم با سطح تورم دارد.

۳. تورم کشورهای طرف تجاری ایران تأثیر مهمی بر تورم ایران نداشته است.

## ۸.۱. روش پژوهش و تجزیه و تحلیل اطلاعات:

در این پژوهش ادبیات نظری موضوع با استفاده از روش‌های اسنادی مبتنی بر مطالعات کتابخانه‌ای مورد بررسی قرار خواهد گرفت. برای بررسی تجربی موضوع، از روش‌های اقتصادسنجی، به طور مشخص الگوهای خودتوضیح برداری غیر مقید و ساختاری (SVAR) استفاده می‌شود.

## ۹.۱. روش گردآوری اطلاعات:

آمار و اطلاعات مورد نیاز در این تحقیق با استفاده از آمار گمرک جمهوری اسلامی ایران، بانک اطلاعاتی سری‌های زمانی و نشریات مختلف بانک مرکزی شامل مجله بانک مرکزی، نماگرهای اقتصادی، گزارش‌های سالیانه، ویژه نامه ارقام فصلی، حساب‌های ملی و ترازنامه جمع‌آوری شده است. سایر آمار و اطلاعات، نظیر نرخ تورم موجود در کشورهای طرف تجاری ایران نیز با استفاده از بانک‌های اطلاعاتی این کشورها و سایت [www.inflation.eu](http://www.inflation.eu) بدست آمده است.

## ۱۰.۱. محدودیت‌ها:

از محدودیت‌های این پایان نامه به روز نبودن اطلاعات و آمار اقتصادی مورد نیاز می‌باشد. در این تحقیق از داده‌های فصلی دوره‌ی ۱۳۸۲-۱۳۹۱ استفاده شده است. از آنجا که نگارش این پایان‌نامه در سال ۱۳۹۲ انجام شده است تلاش گردید تا تحولات سه فصل اول این سال نیز مورد بررسی قرار گیرد اما به دلیل نبود آمار و اطلاعات این هدف میسر نگردید.

## ۱۱.۱. سازماندهی تحقیق:

تحقیق حاضر از شش فصل تشکیل شده است. در فصل اول کلیاتی در مورد مسئله پژوهش و اهمیت و ضرورت انجام آن، قلمرو، اهداف، سؤالات، فرضیه‌ها، روش تحقیق، روش گردآوری اطلاعات و محدودیت‌های پژوهش بیان شده است.

در فصل دوم که به بررسی ادبیات و مبانی نظری تورم اختصاص دارد، ابتدا تعریفی از تورم وارداتی، مخارج دولت، تورم و انواع آن بیان شده، سپس نظریه‌های اقتصادی در زمینه‌ی دلایل تورم معرفی شده‌اند و بعد از آن به آسیب‌شناسی مسأله تورم پرداخته شده است.

در فصل سوم پیشینه‌ای از مطالعات صورت گرفته در زمینه‌ی عوامل مؤثر بر تورم در دو بخش مطالعات مربوط به خارج از کشور و مطالعات مربوط به داخل کشور آورده شده است.

در فصل چهارم مروری بر روند تورم و متغیرهای مدل و دلایل افزایش یا کاهش آن‌ها در طی سال‌های مورد بررسی صورت گرفته است.

در فصل پنجم ضمن معرفی الگوهای خودرگرسیون برداری و خودرگرسیون برداری ساختاری به معرفی و تخمین مدل با استفاده از هر دو الگو پرداخته شده است. پس از آن نتایج تخمین مورد تحلیل و بررسی قرار گرفته است.

فصل پنجم نیز به بیان نتایج تحقیق، ارزیابی فرضیه‌ها و توصیه‌های سیاستی اختصاص یافته است.