

تولید و نرخ ارز

احسان سلطانی
اردیبهشت ۱۳۹۷

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

الْآتِزُ وَازِرَةُ وَزَرَ أَخْرَى (٧) نَسْع

وَأَنْ لِّبَسْرٍ لِّلْأَنْشَرِكِ الْإِمَامَا

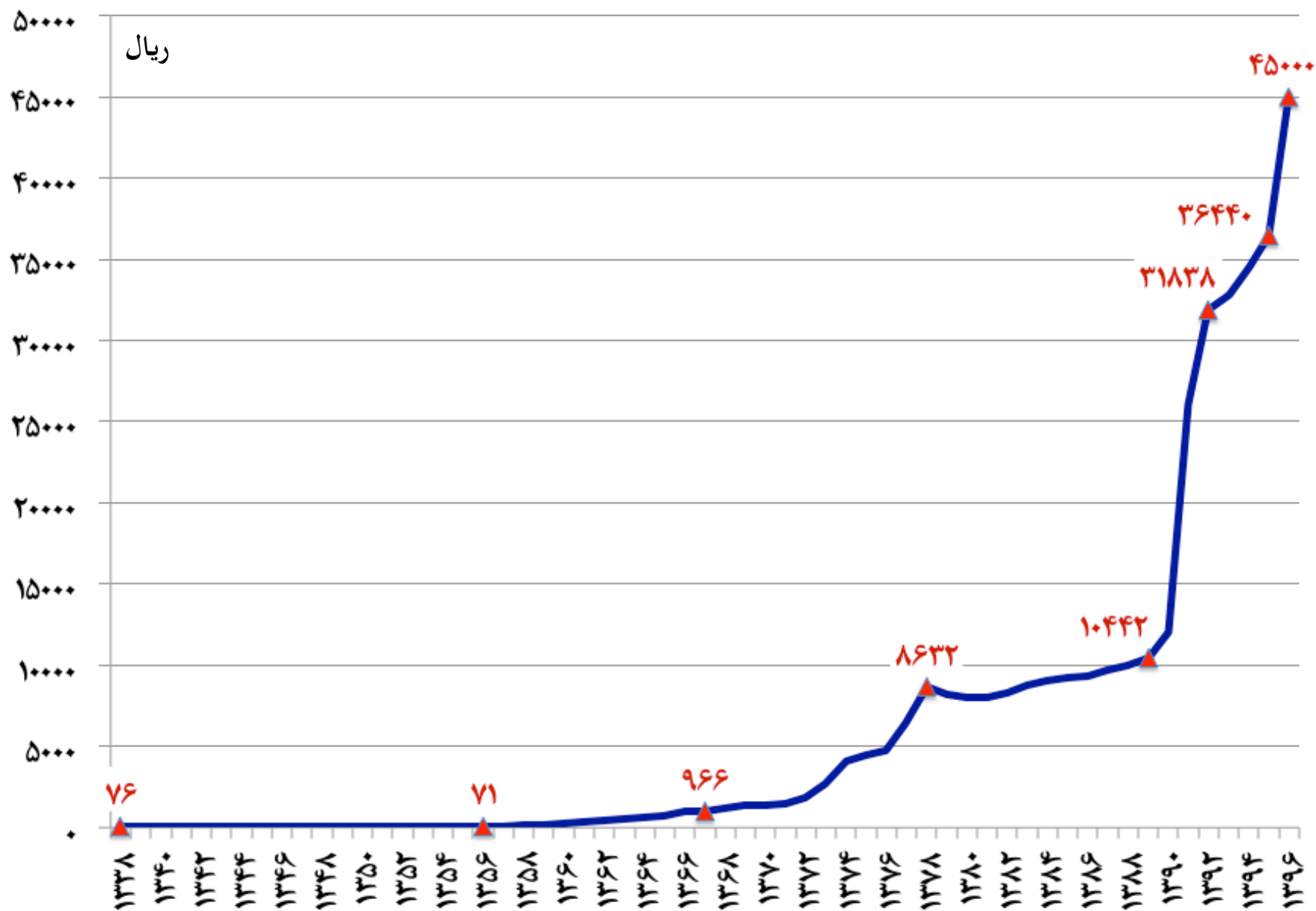
سرفصل ها

- ۱- روند نرخ ارز در شش دهه اخیر و عوامل تاثیرگذار
- ۲- اقتصاد رانتیر نفتی و تامین ارز خارجی در اقتصاد ایران
- ۳- ترکیب اقلام صادراتی ایران
- ۴- ترکیب واردات ایران و قاچاق
- ۵- استراتژی های صادراتی مبتنی بر نرخ ارز
- ۶- روند توسعه صنعتی کشور و ارتباط آن با سیاست های ارزی
- ۷- مزیت های رقابتی یا رانتی و عوامل تاثیرگذار بر رقابت پذیری اقتصادی
- ۸- چالش های تولید در ایران و عوامل قیمت تمام شده و رشته های صنعتی در رکود
- ۹- صنایع منتفع از رانت شوک نرخ ارز و اثرات آن بر روی تولید در ایران
- ۱۰- تاثیر افزایش نرخ ارز بر روی تشدید رکود اقتصادی فعالیت مردم و بخش خصوصی و صنایع کوچک و متوسط و سطح معیشت مردم

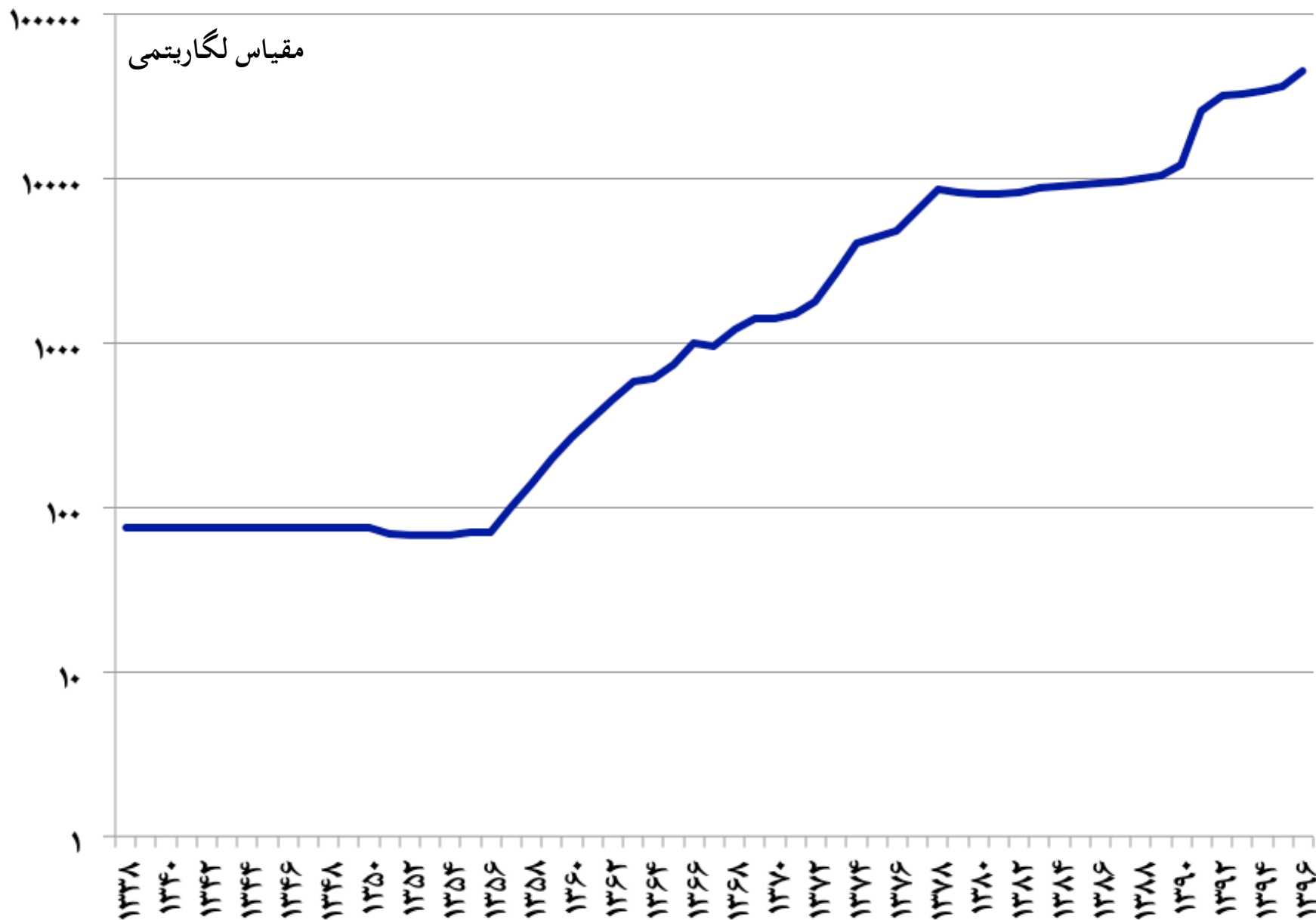
روند تاریخی



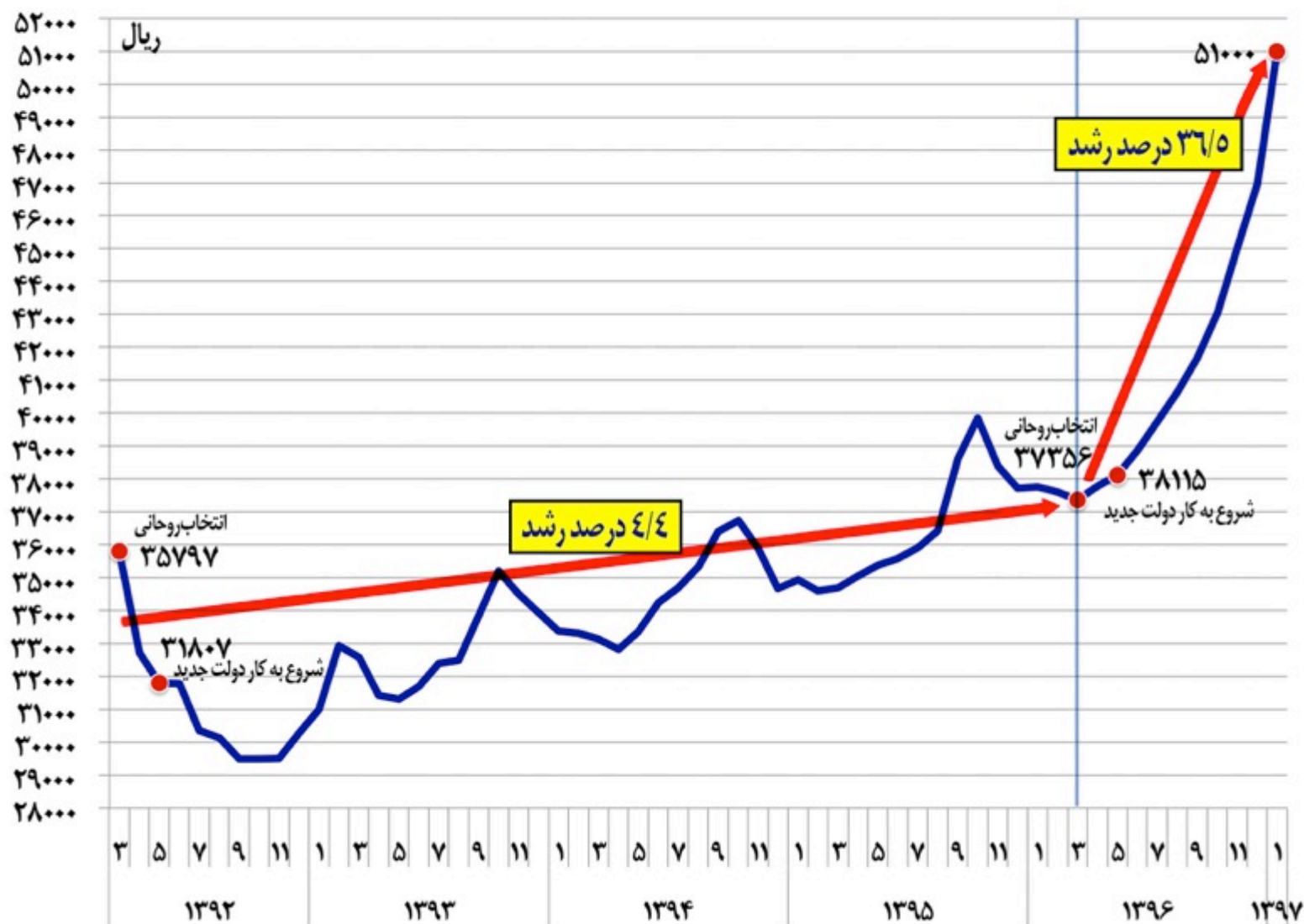
روند افزایش نرخ ارز (دلار آمریکا) در شش دهه اخیر



روند افزایش نرخ ارز (دلار آمریکا) در شش دهه اخیر



بهای دلار در بازار آزاد تهران (از زمان انتخاب حسن روحانی در سال ۱۳۹۲ تا فروردین ۱۳۹۷)



تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی



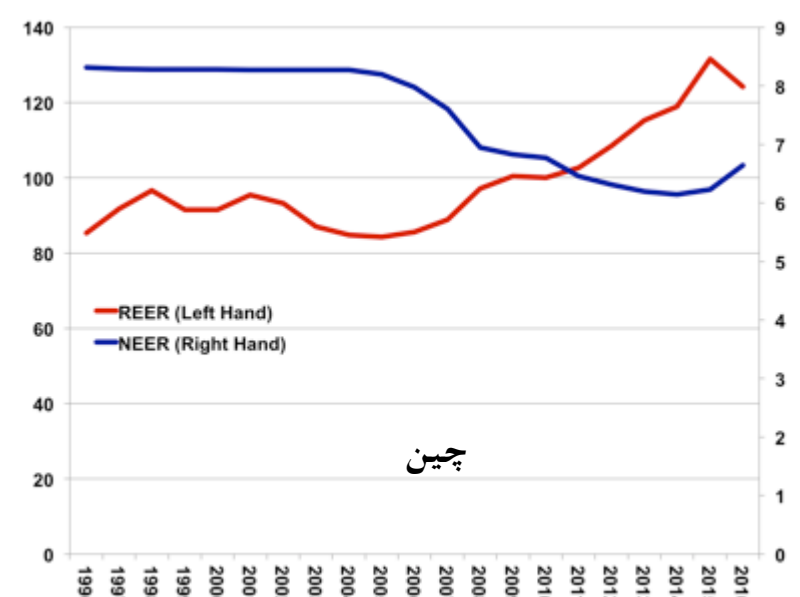
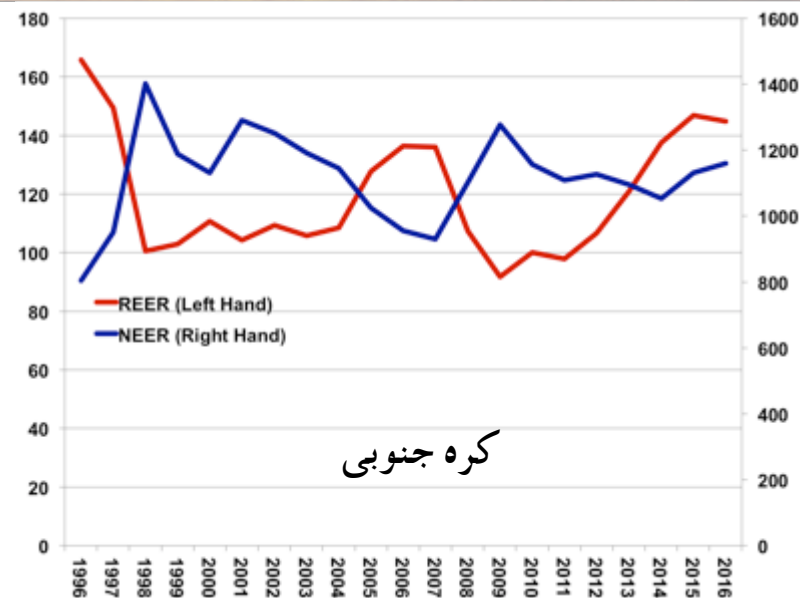
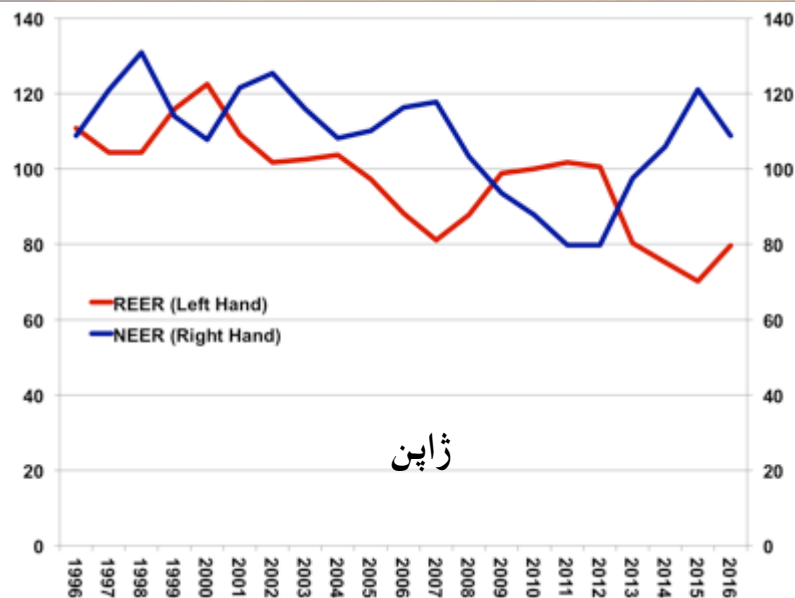
نرخ تبدیل ارز اسمی و حقیقی

نرخ تبدیل ارز موثر اسمی (NEER) و نرخ تبدیل ارز موثر حقیقی (REER)

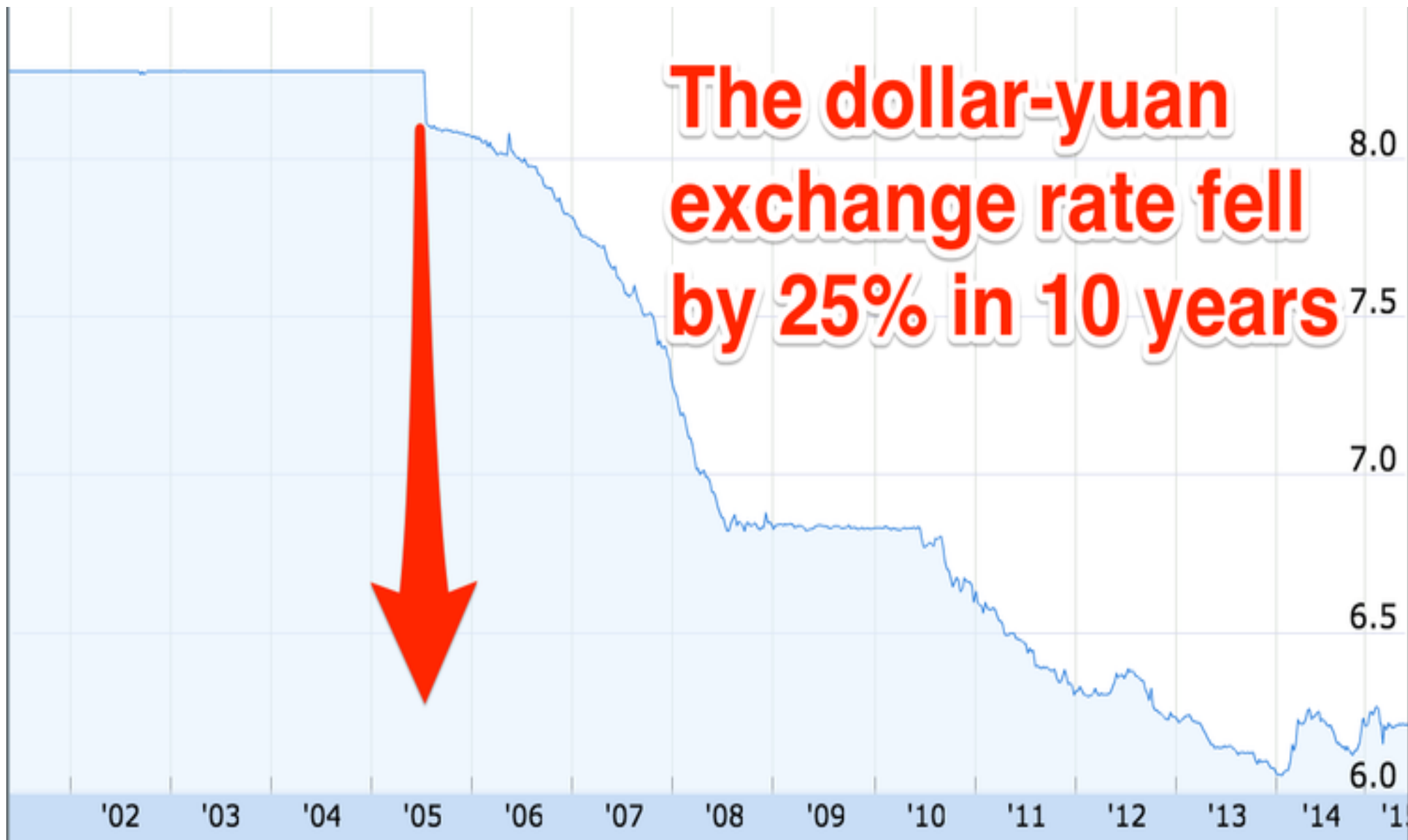
محاسبه نرخ برابری ارز و به اصطلاح نرخ تبدیل ارز حقیقی (REER) بسیار پیچیده تر از معادلات و نسبت های سطحی در دوره های کوتاه مدت است، که این روزها سکه رایج شده است.

در یک اقتصاد مبتنی بر بازار، این محاسبه بر اساس پارامترهای مختلفی از جمله شاخص ضمنی تعدیل کننده تولید ناخالص داخلی، نرخ تورم سبد کالاها و خدمات صادراتی و وارداتی، نرخ تورم مصرف کننده، نرخ تورم تولیدکننده، نرخ سود بانکی و هزینه حقیقی نیروی کار محاسبه می شود، آن هم در مقایسه با ترکیبی از کشورهای طرف معاملات اقتصادی و نه کشورهایی مانند آمریکا که شرایط کنونی ایران با آن تناسب و شباهتی ندارد و حتی مراوده تجاری برقرار نیست. در این راستا انتخاب سال پایه اهمیت بالایی دارد و خروجی را تحت تاثیر خود قرار می دهد.

رشد نرخ تبدیل ارز اسمی و حقیقی کشورهای منتخب در دو دهه اخیر

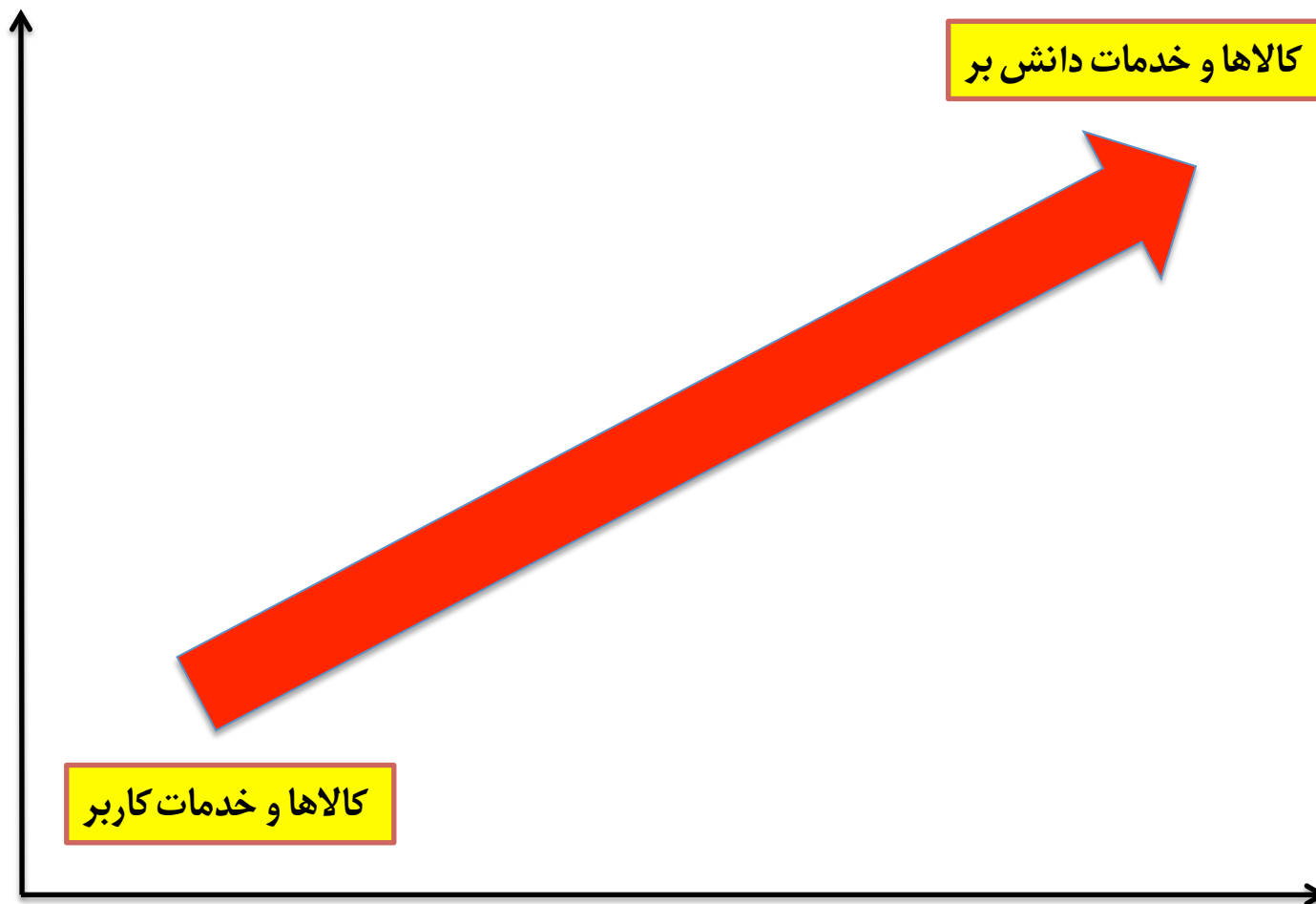


کاهش ارزش پول داخلی رقابتی (Competitive Devaluation)



روند توسعه

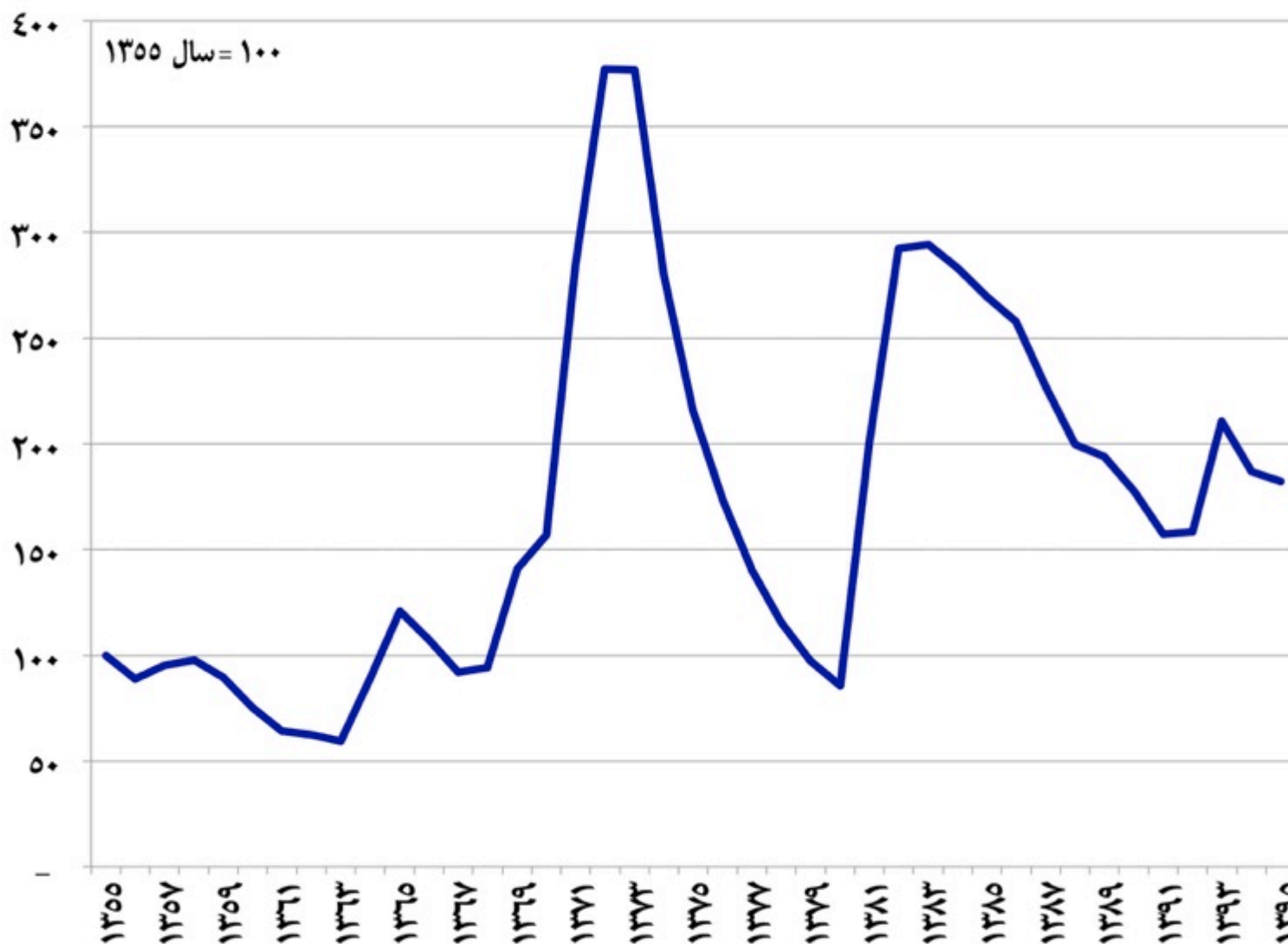
جامعه دانش بنیان
اقتصاد توسعه یافته
رفاه اقتصادی و اجتماعی
افزایش ارزش پول ملی



تامین ارز خارجی در اقتصاد ایران

در اقتصاد ایران دولت تامین کننده و عرضه کننده اصلی ارز است و بیش از ۹۰ درصد درآمد ارزی از محل فروش ثروت ها و منابع و مواد خام و اولیه (به واسطه تزریق رانت منابع) حاصل می شود و نه در نتیجه کار و تلاش و نوآوری مردم. اقتصاد تک محصولی برونزا و درون گرای ایران برای حرکت به نیروی محرکه بیرونی درآمد ارزی حاصل از فروش ثروت ها و منابع خام و اولیه محتاج است. حتی آن چه که به عنوان صادرات غیرنفتی مطرح می شود، در اصل نفتی است یا از رانت منابع ملی بهره می گیرد و به سرچشمه ثروتهای ملی وصل است. صادرات پتروشیمی و فولاد با رانت گسترده مواد خام و انرژی ممکن شده است. بخش اعظم صادرات کشاورزی هم به انرژی بسیار ارزان برای بهره برداری بی رویه از ذخایر محدود و رو به نابودی آبهای زیرزمینی تکیه دارد. در این اقتصاد ارز خارجی منبع تامین بخش با اهمیتی از کالاهای اساسی و مواد اولیه، واسطه ای و مصرفی مورد نیاز مردم و صنایع داخلی است. اقتصاد ایران قادر به تولید ارز نیست و ارزی هم که عرضه می شود یا مستقیماً از فروش منابع خام به دست می آید یا به واسطه اعطای مجوزها و رانت های دولت به گروه های منتخب، از صادرات منابع خام یا تولید مواد اولیه از آنها حاصل می شود. بنابراین منشاء تحصیل ارز کار و تلاش جامعه و صادرات کالاهای و خدمات کاربری یا دانش بر مانند اکثر اقتصادها نیست که از قاعده مشابه آنها استفاده شود.

شاخص نرخ تبدیل ارز موثر حقیقی ایران (بر اساس نرخ رسمی ارز)

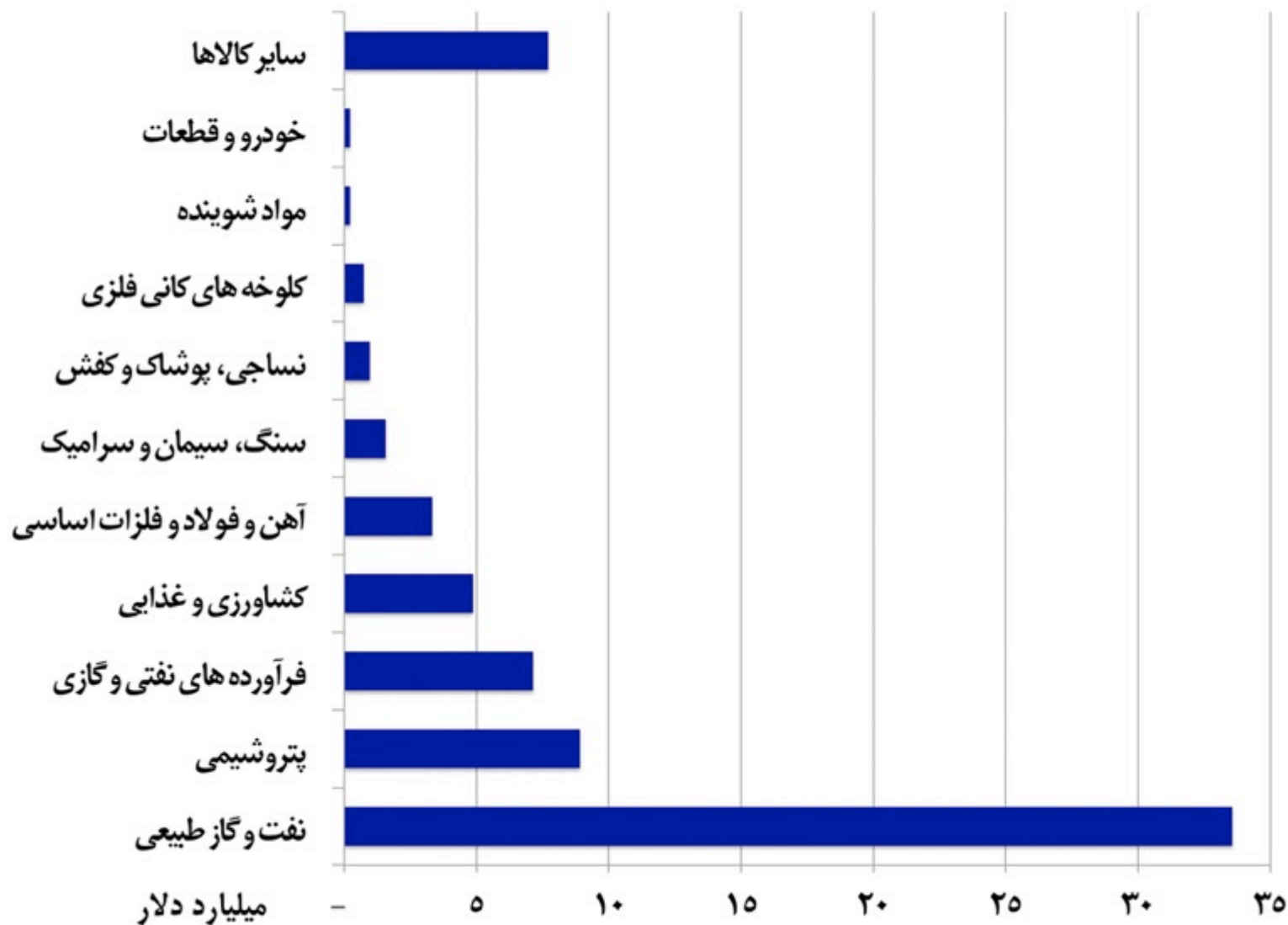


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک جهانی

تجارت خارجی

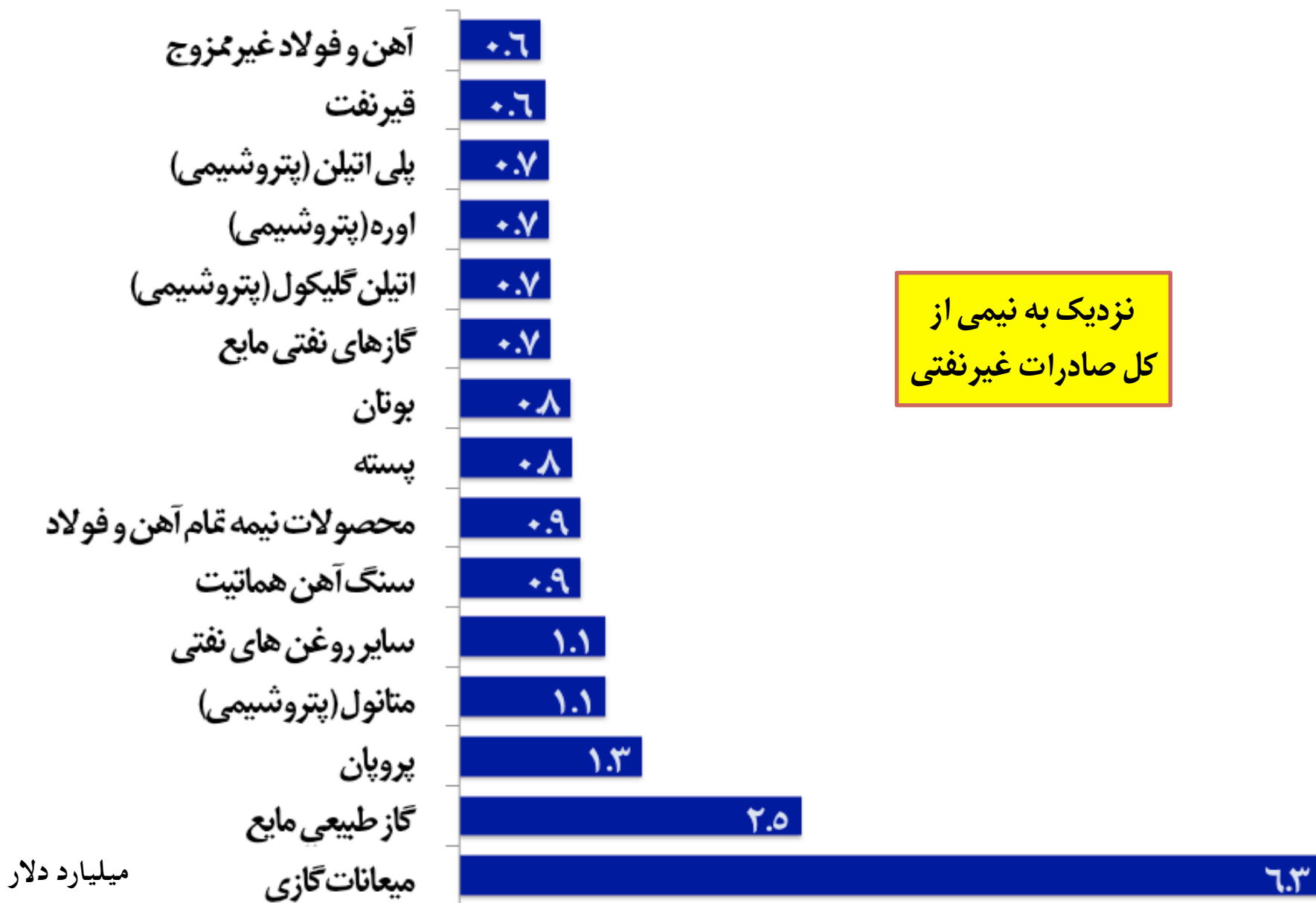


ترکیب صادرات رسمی کالاها از ایران (۱۳۹۴)

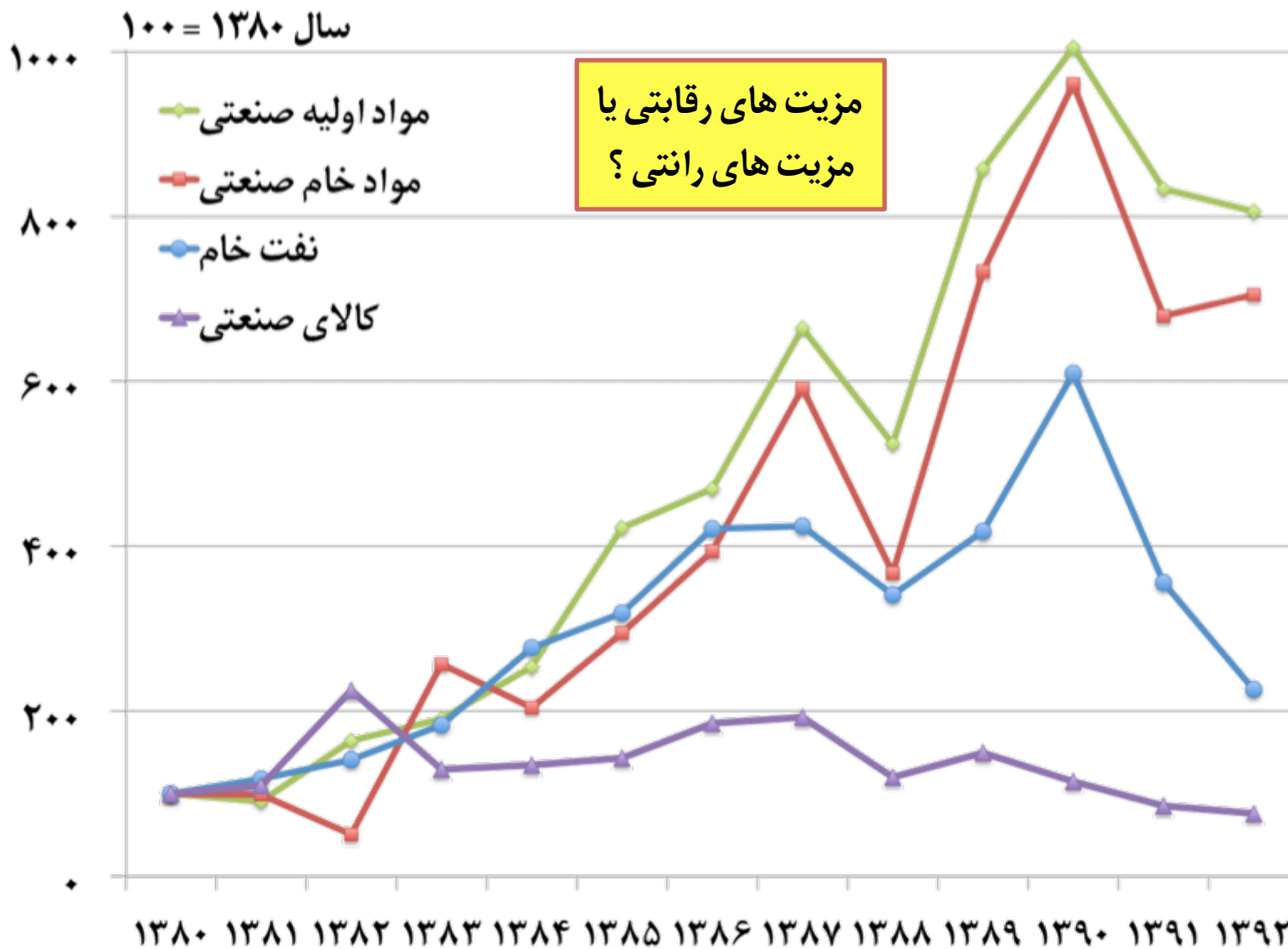


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی ایران

اقلام عمده صادرات غیر نفتی یازده ماهه سال ۱۳۹۶

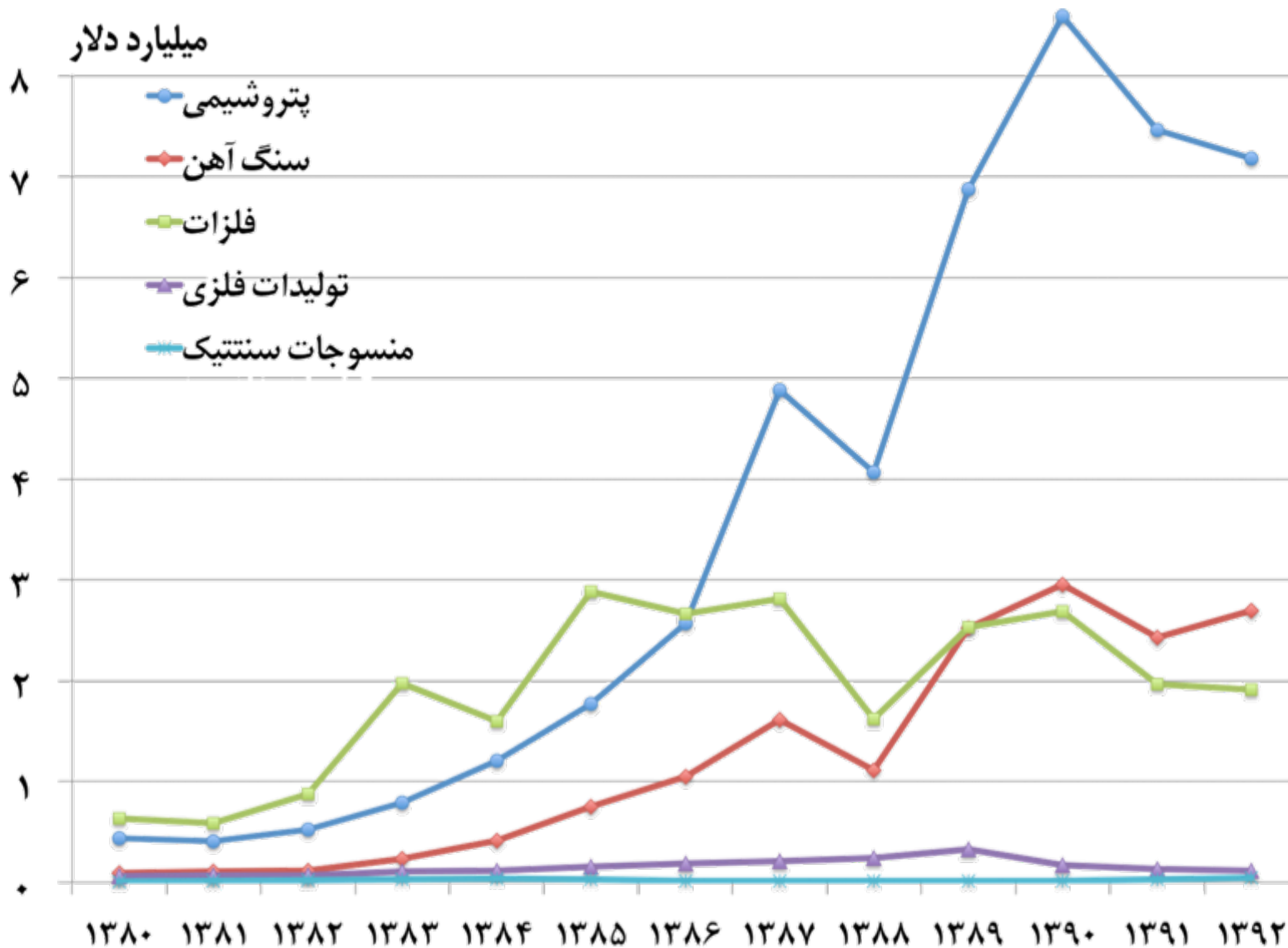


روند رشد صادرات ایران بر اساس سطح خام فروشی



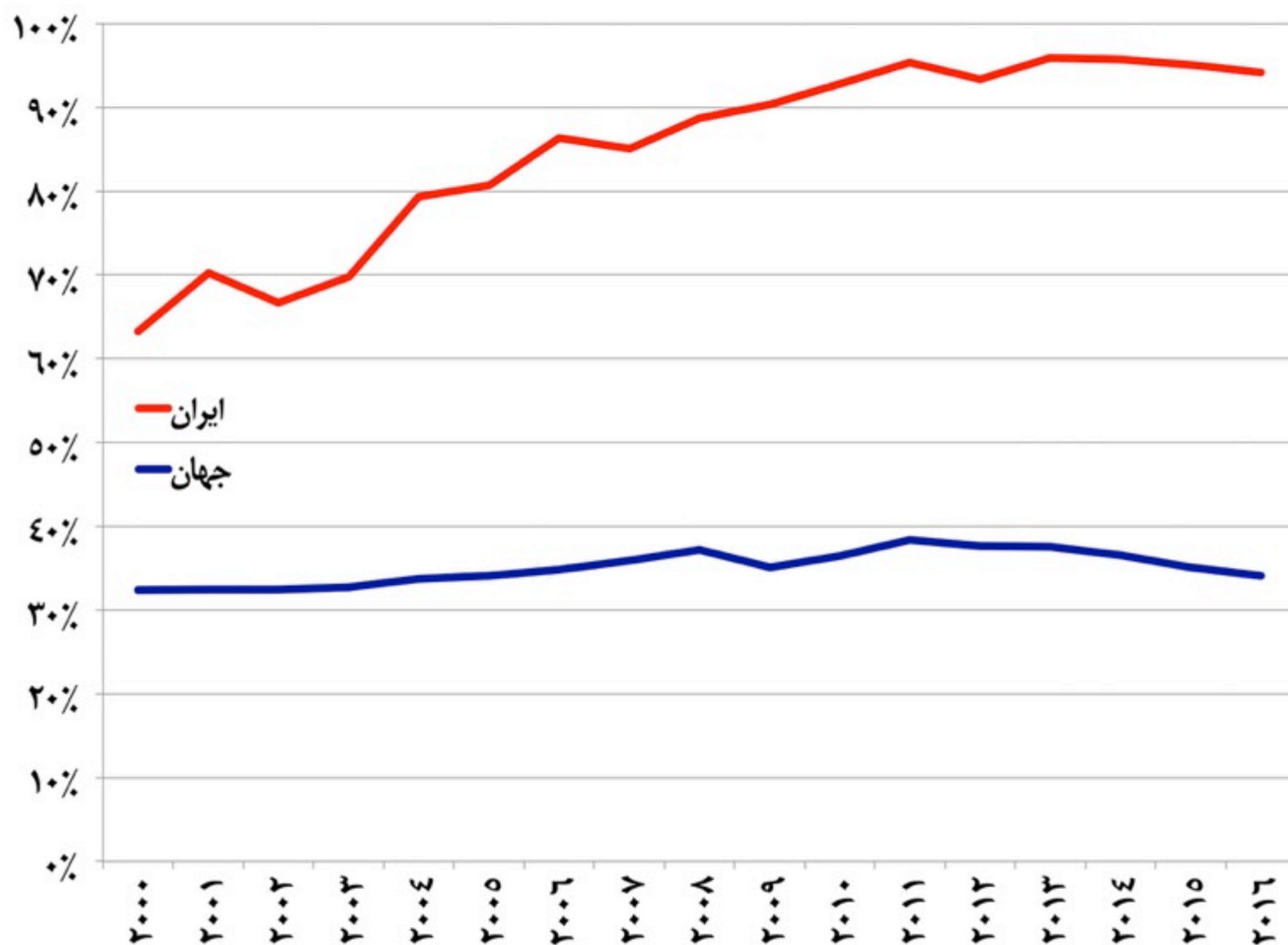
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های سازمان تجارت جهانی و گمرک ایران

رشد صادرات ایران در زنجیره های ارزش صنعتی



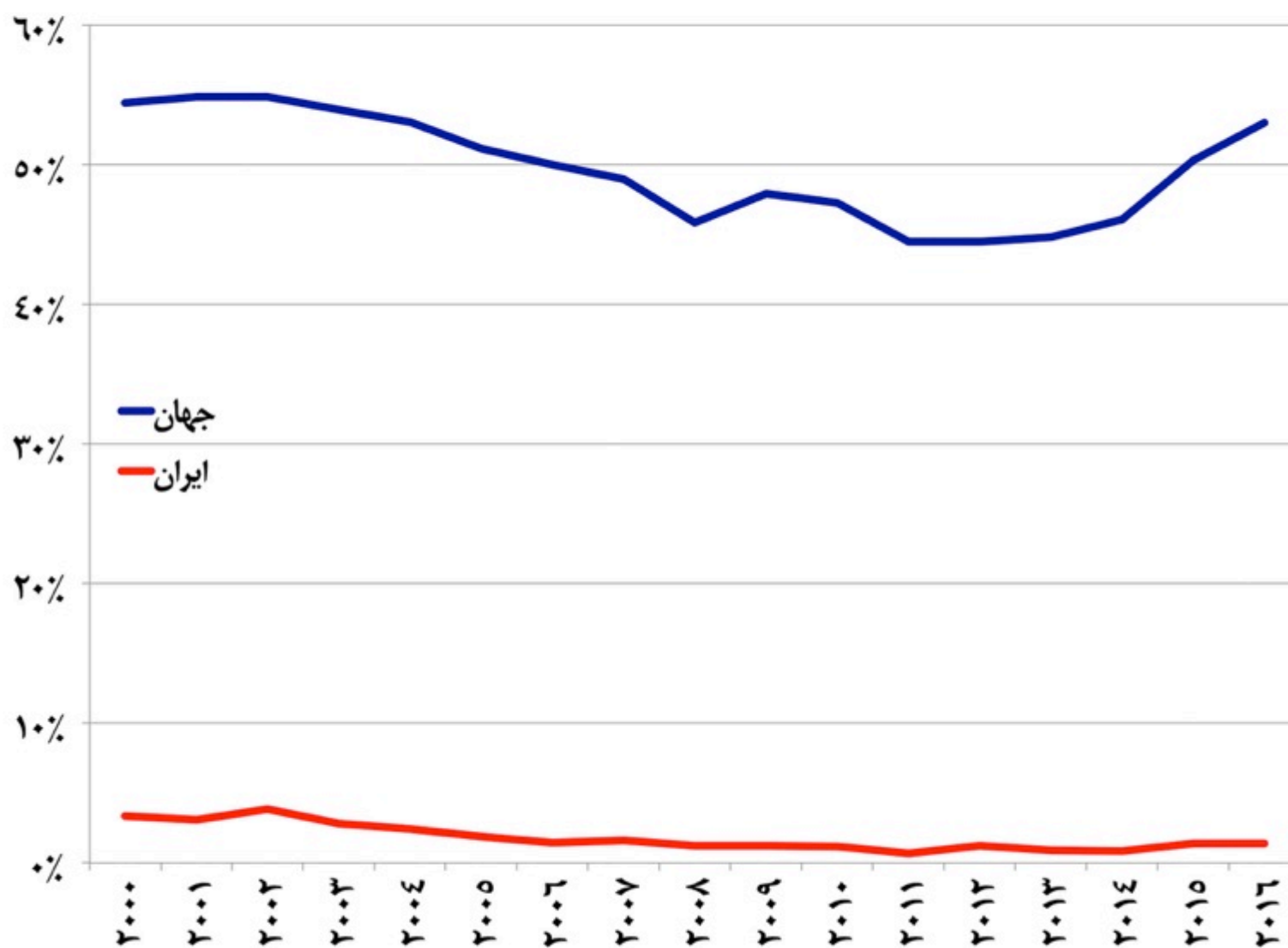
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های سازمان تجارت جهانی و گمرک ایران

سهم مواد خام و اولیه از کل صادرات کالاهای صنعتی ایران و جهان



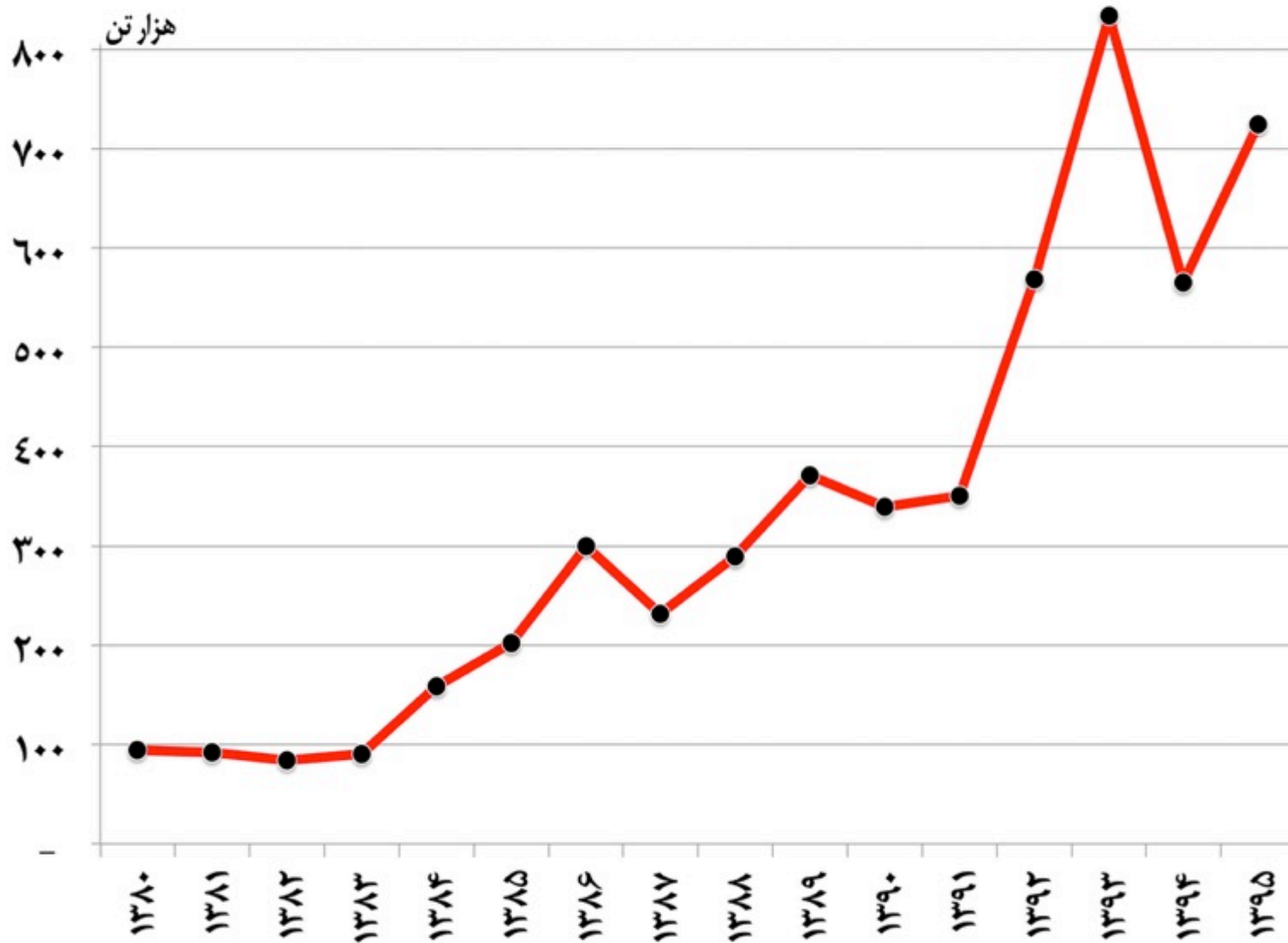
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های سازمان تجارت جهانی

سهم کالاهای صنعتی نهایی (سرمایه ای، وسایل نقلیه و مصرفی) از کل صادرات ایران و جهان



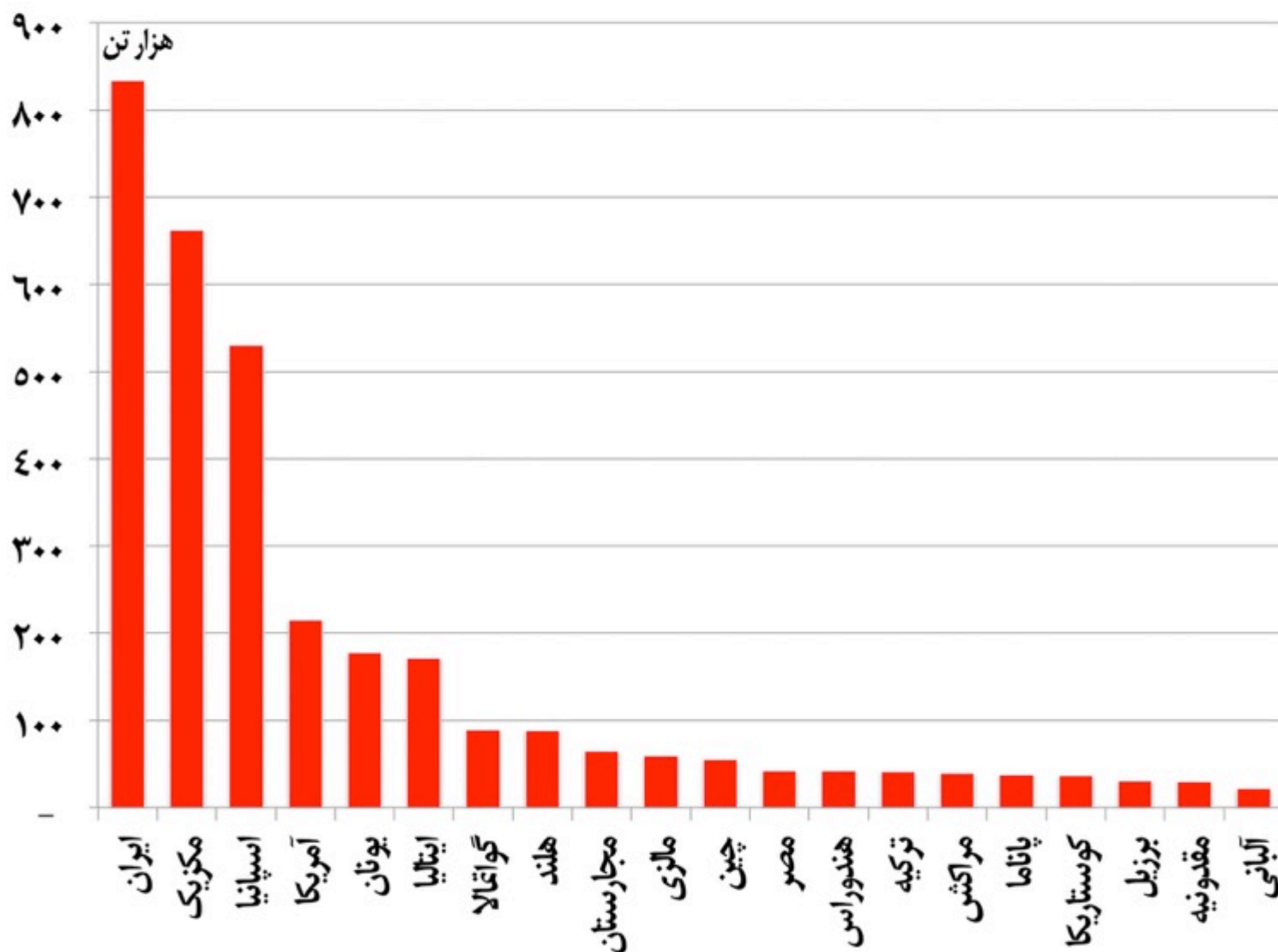
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های سازمان تجارت جهانی

روند رشد صادرات هندوانه ایران



تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های گمرک ایران

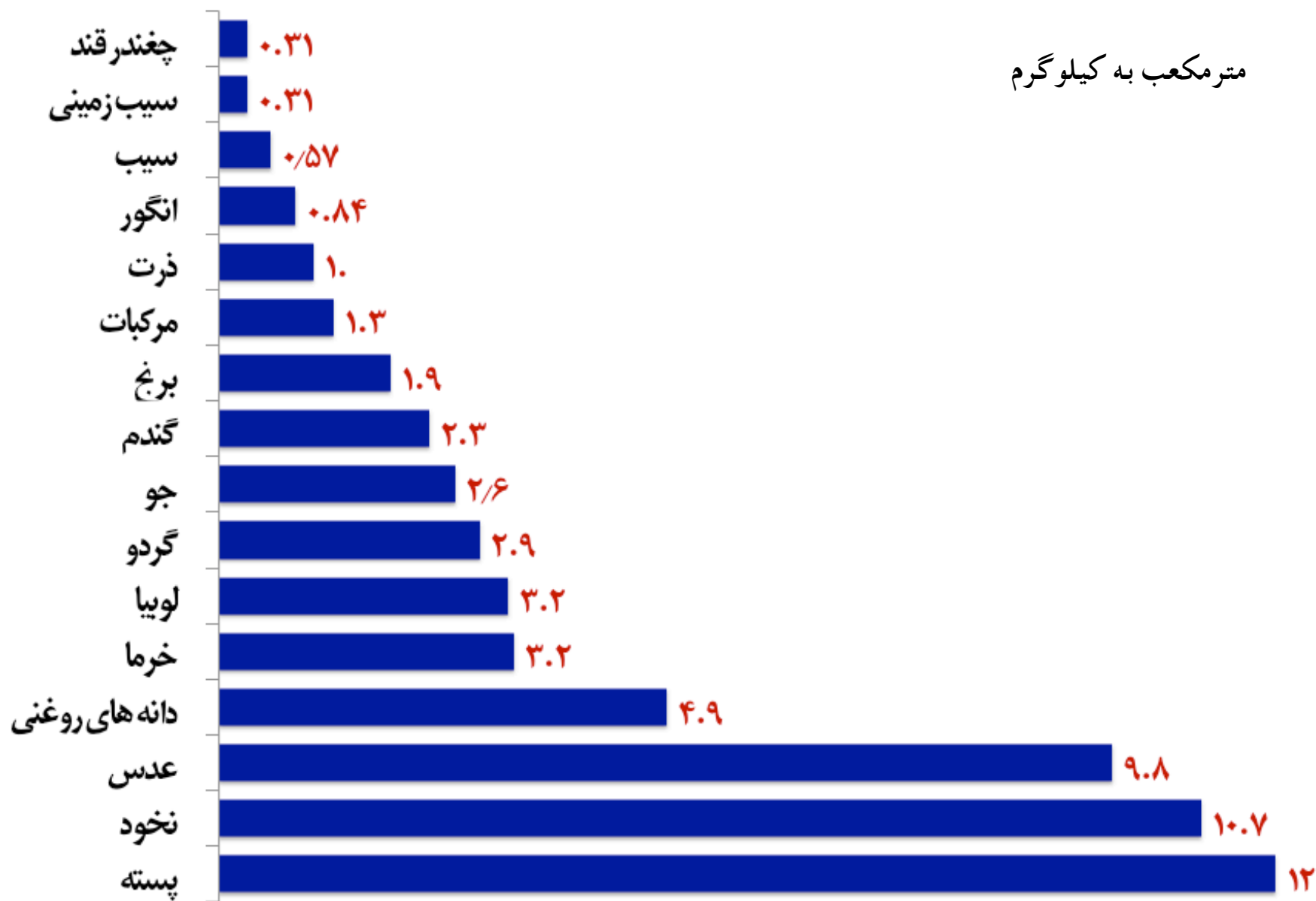
بیست صادرکننده اول هندوانه در جهان (۱۳۹۳ شمسی / ۲۰۱۴ میلادی)



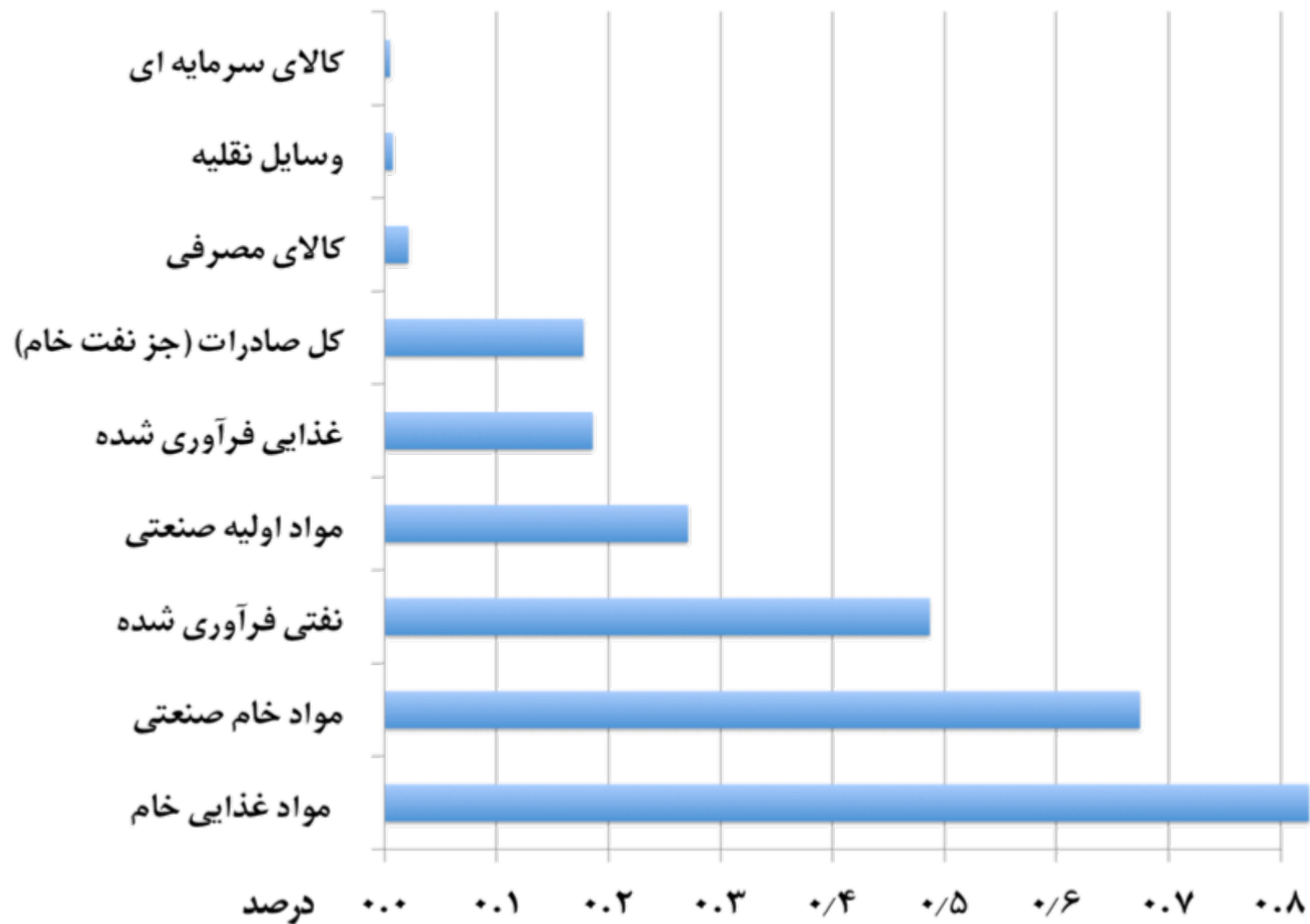
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های گمرک ایران و سازمان تجارت جهانی

میزان مصرف آب مجازی جهت تولید محصولات کشاورزی

مترمکعب به کیلوگرم

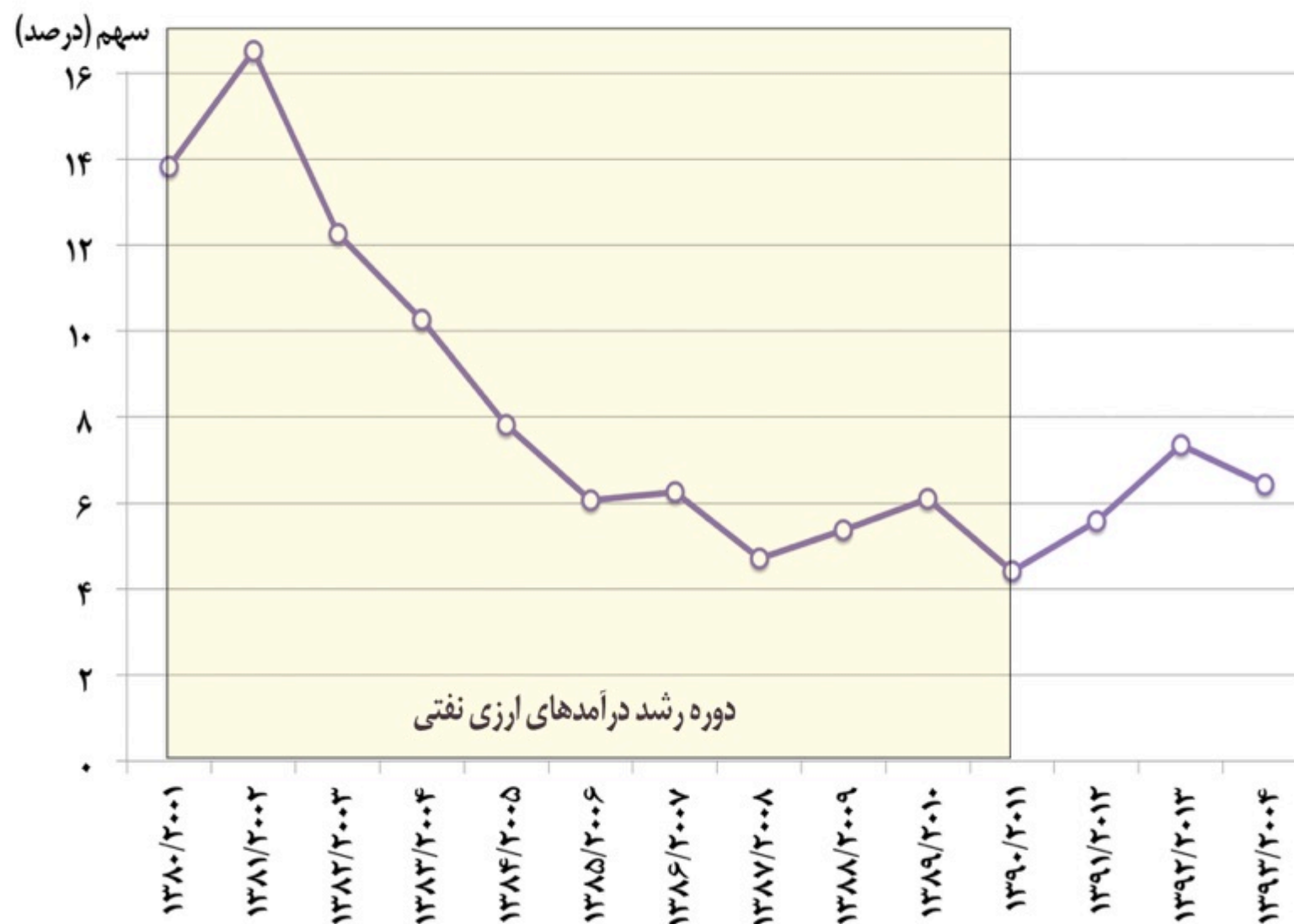


سهم صادرات ایران از کل جهان (۱۳۹۰ ، درصد)



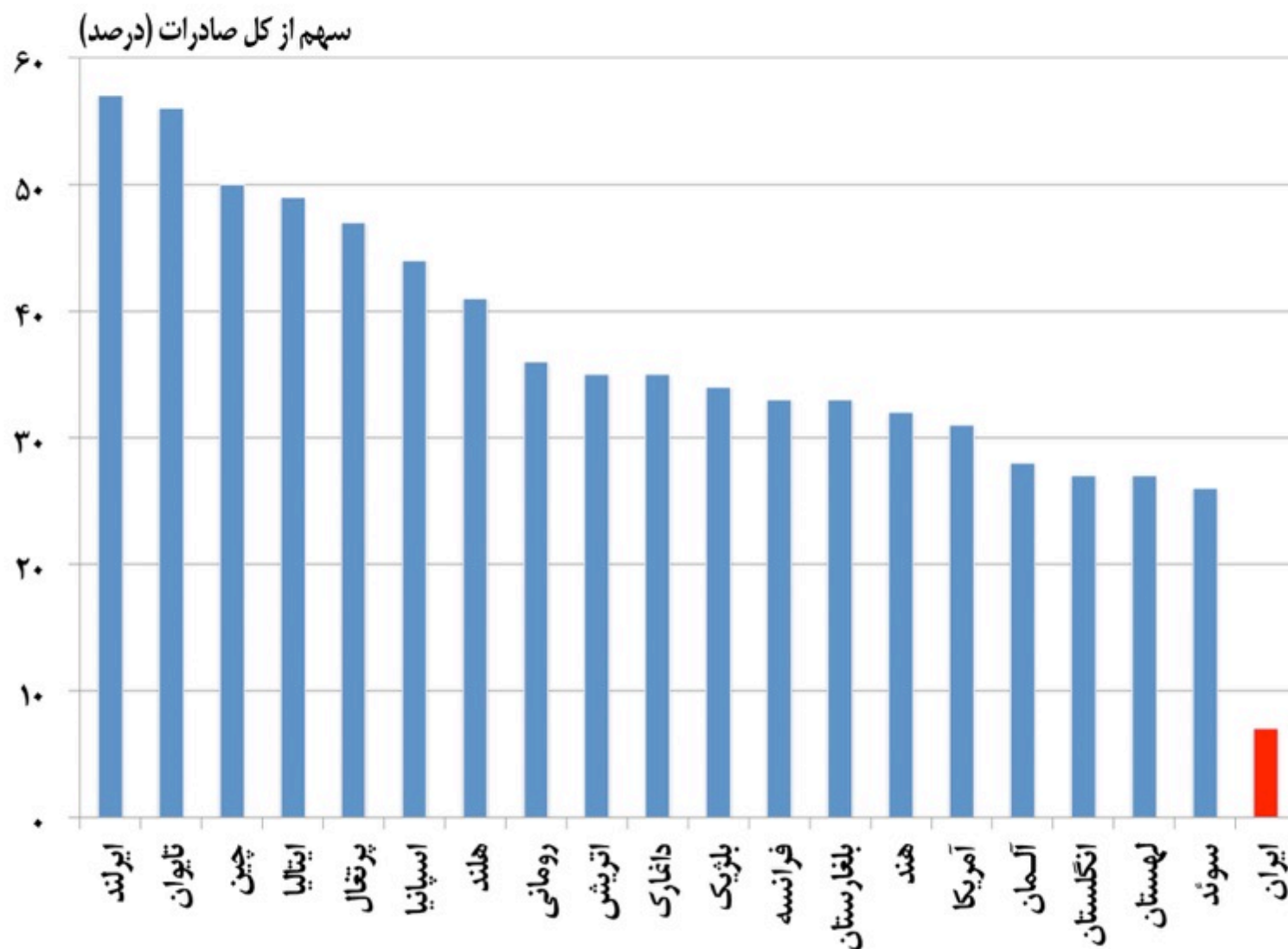
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های سازمان تجارت جهانی و گمرک ایران

برآورد سهم بنگاه های کوچک و متوسط از کل صادرات ایران



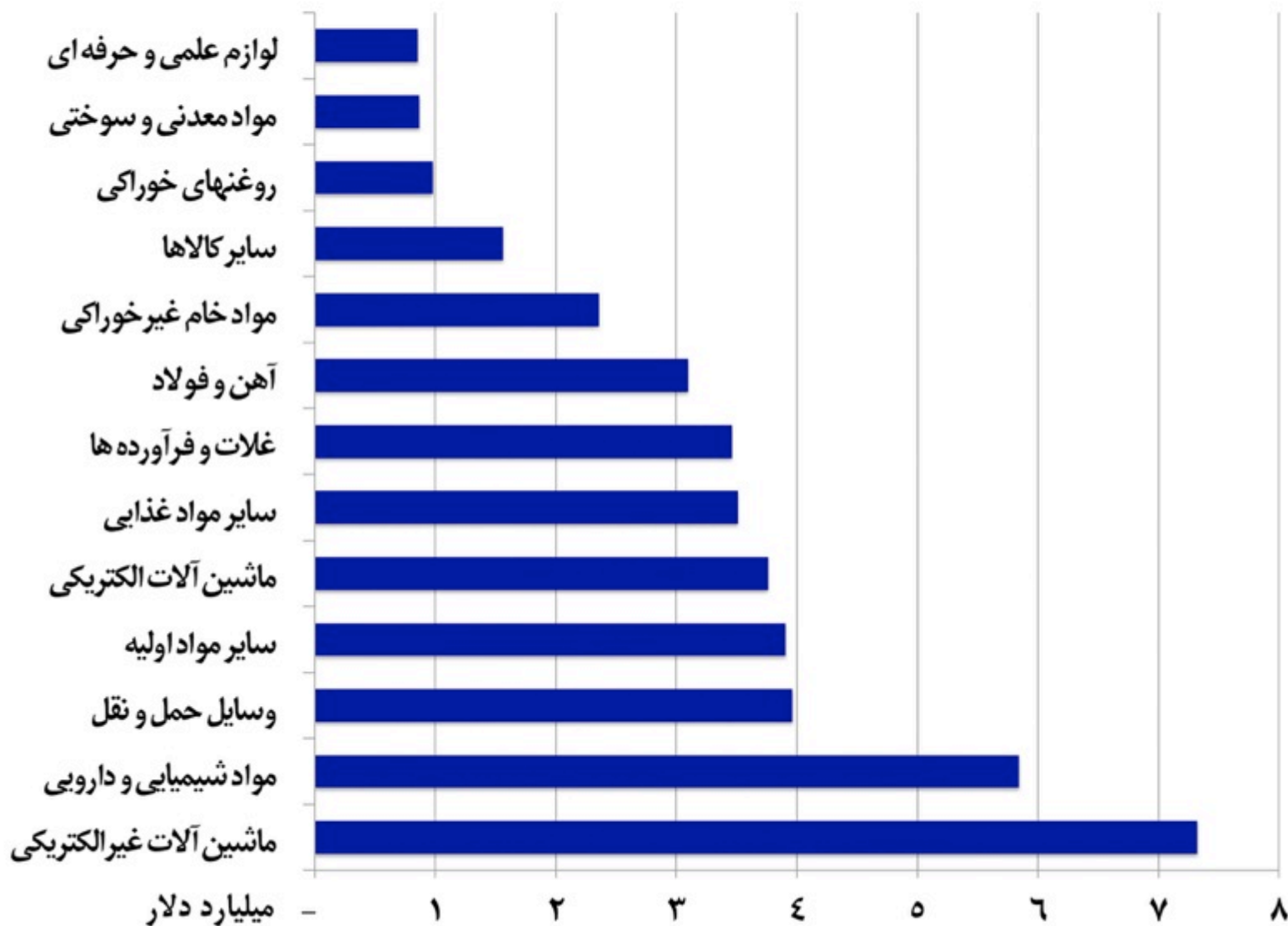
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های سازمان تجارت جهانی

سهم بنگاه های کوچک و متوسط از کل صادرات



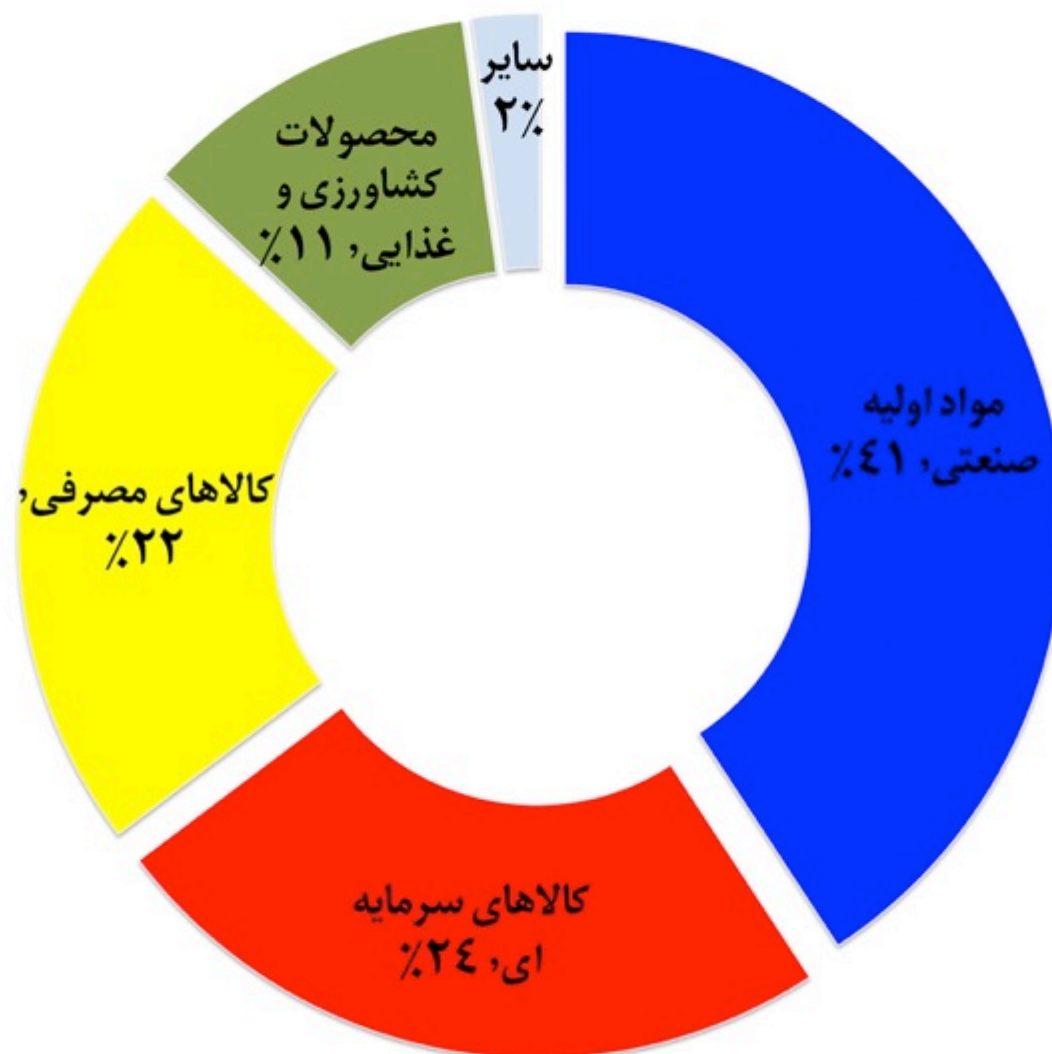
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک جهانی و سازمان تجارت جهانی

ترکیب واردات رسمی ایران بر اساس طبقه بندی بین المللی کالاها (۱۳۹۴)

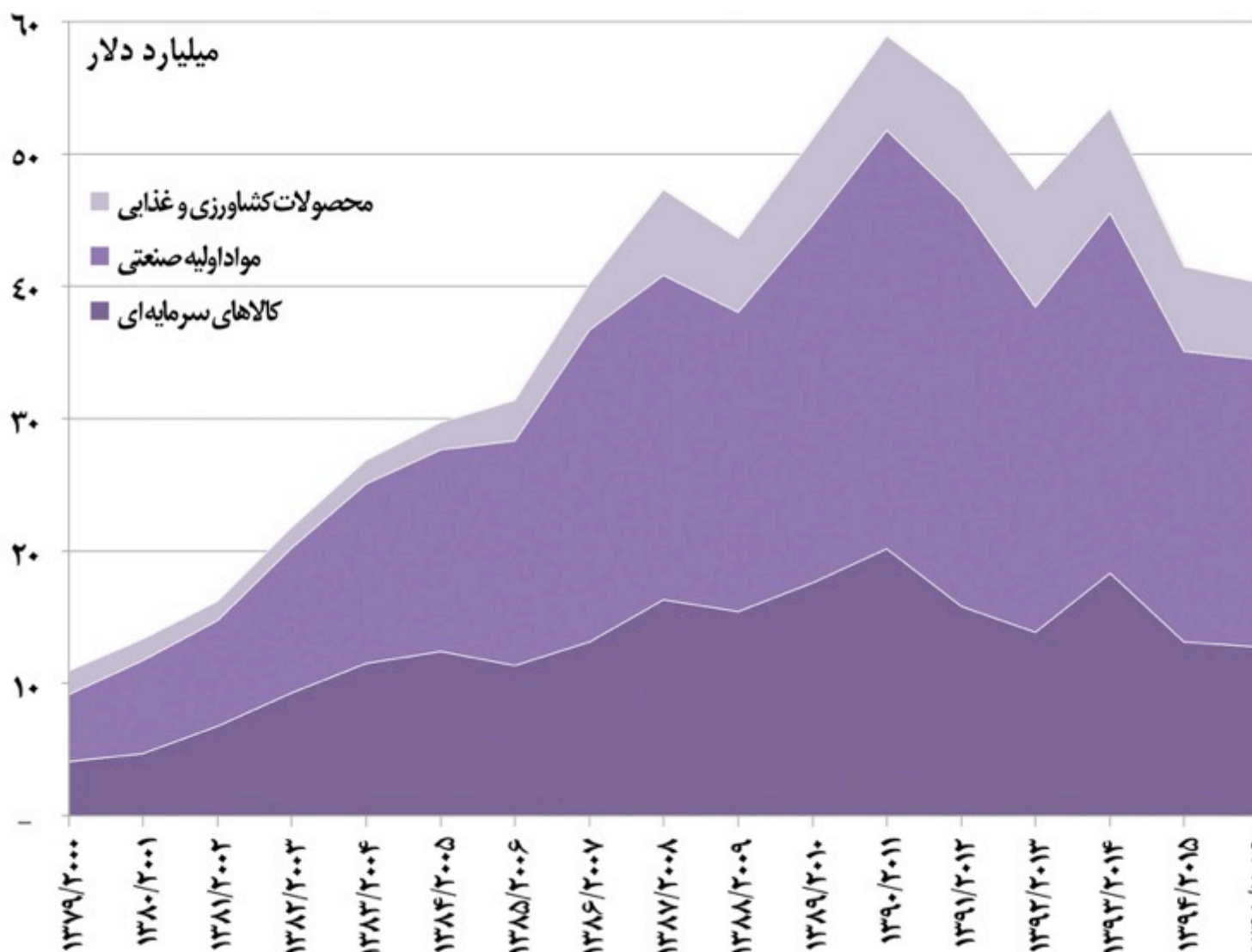


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی ایران

ترکیب واردات ایران با احتساب ۱۰ میلیارد دلار قاچاق (۲۰۱۶ میلادی، ۱۳۹۵ شمسی)

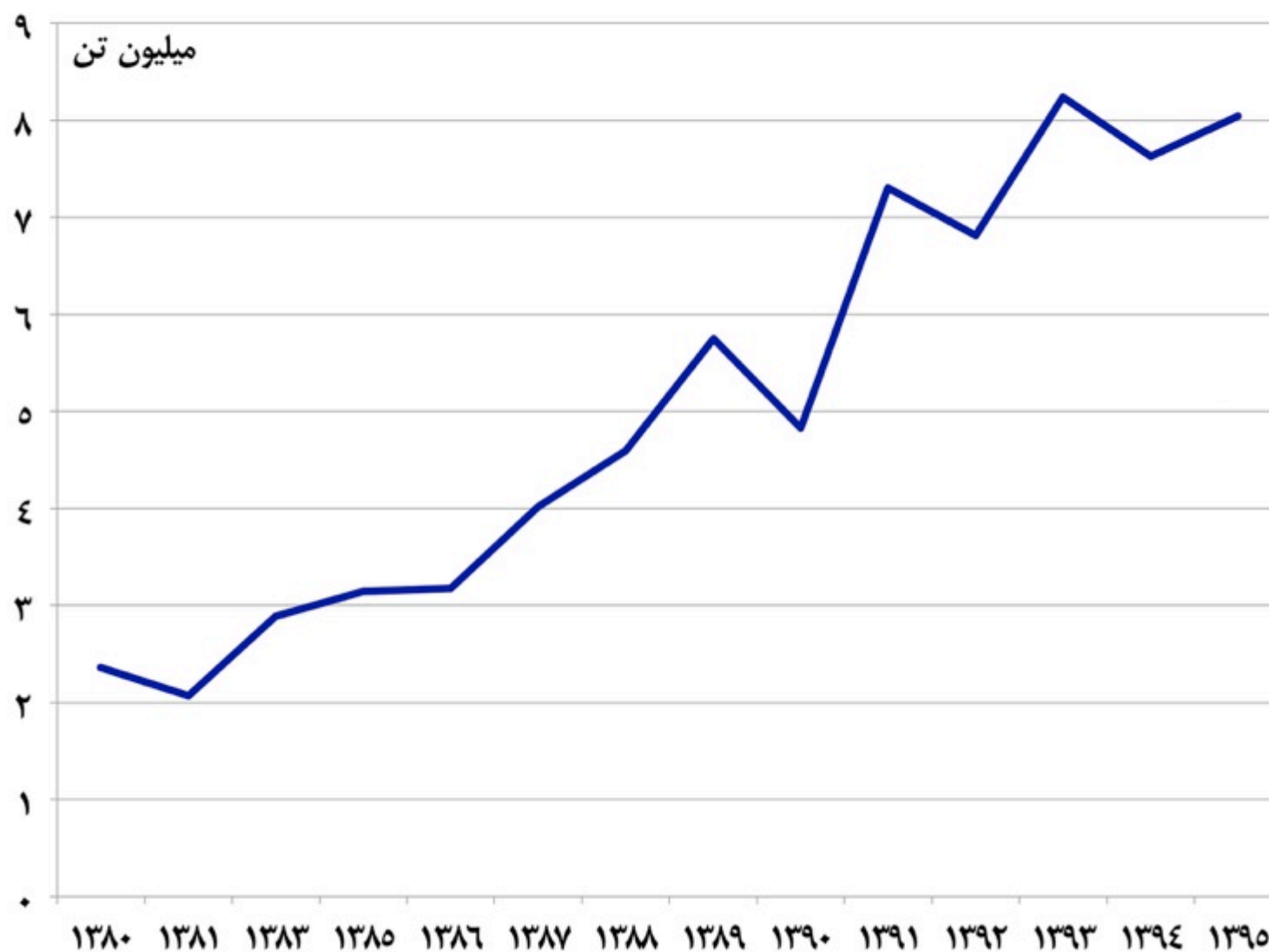


روند واردات کالاهای سرمایه‌ای، مواد اولیه صنعتی و محصولات کشاورزی و غذایی ایران



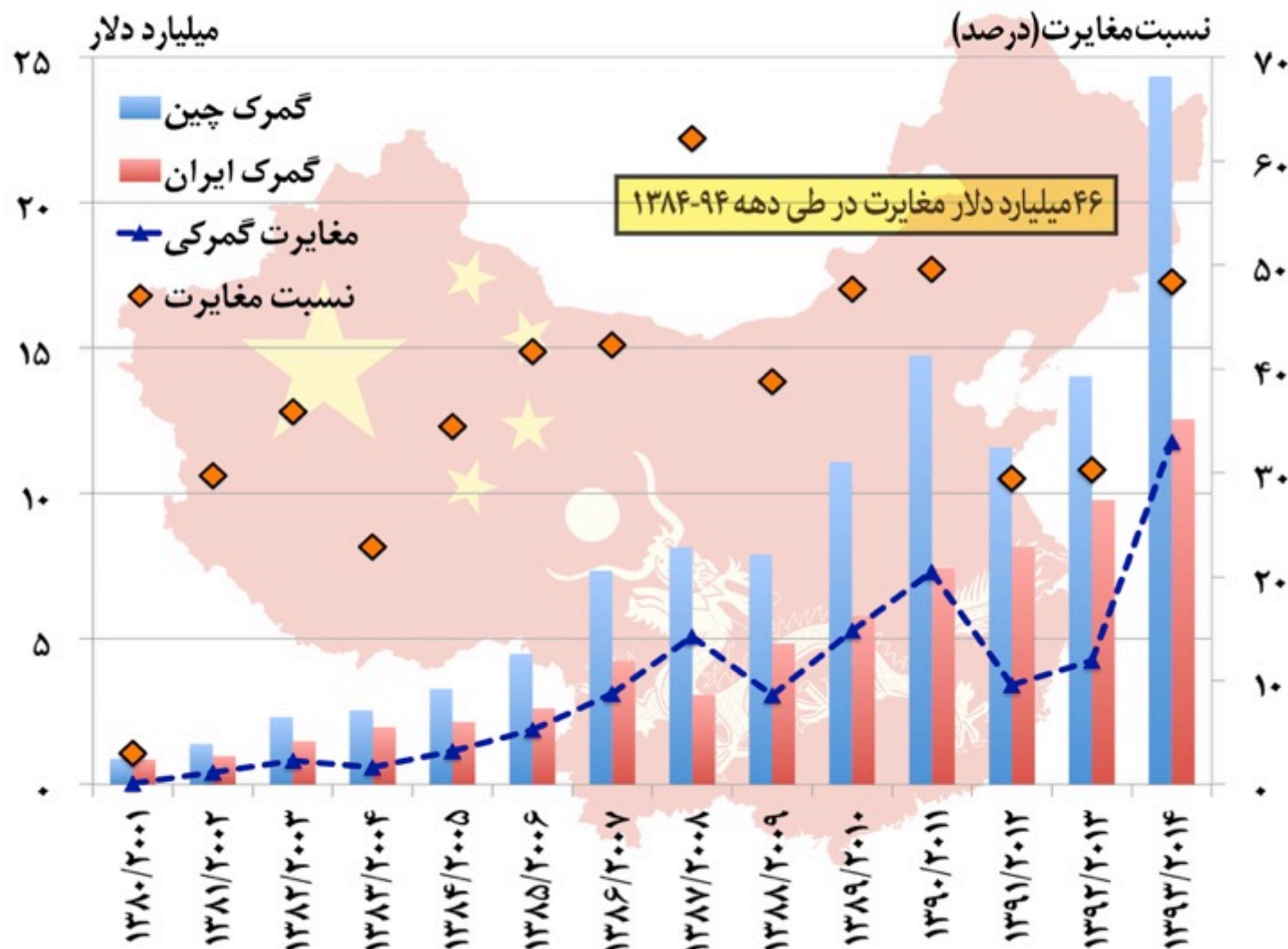
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده‌های سازمان تجارت جهانی

روند رشد واردات خوراک دام (ذرت دامی و کنجاله سویا)



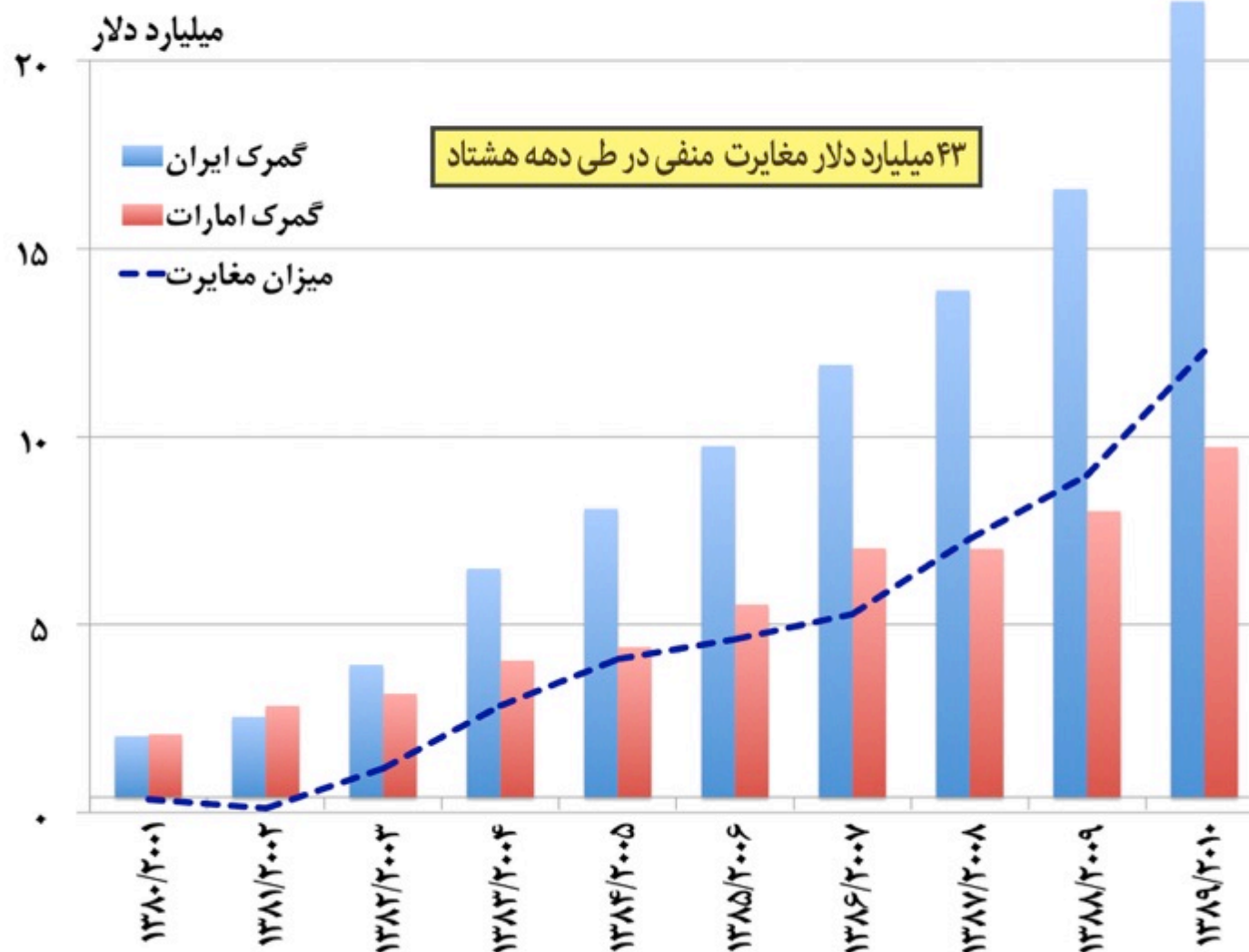
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های گمرک ایران

مقایسه ارزش اعلامی گمرک های چین و ایران در واردات از چین



تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های گمرک های ایران و چین

مقایسه ارزش اعلامی گمرک های ایران و امارات در واردات از امارات

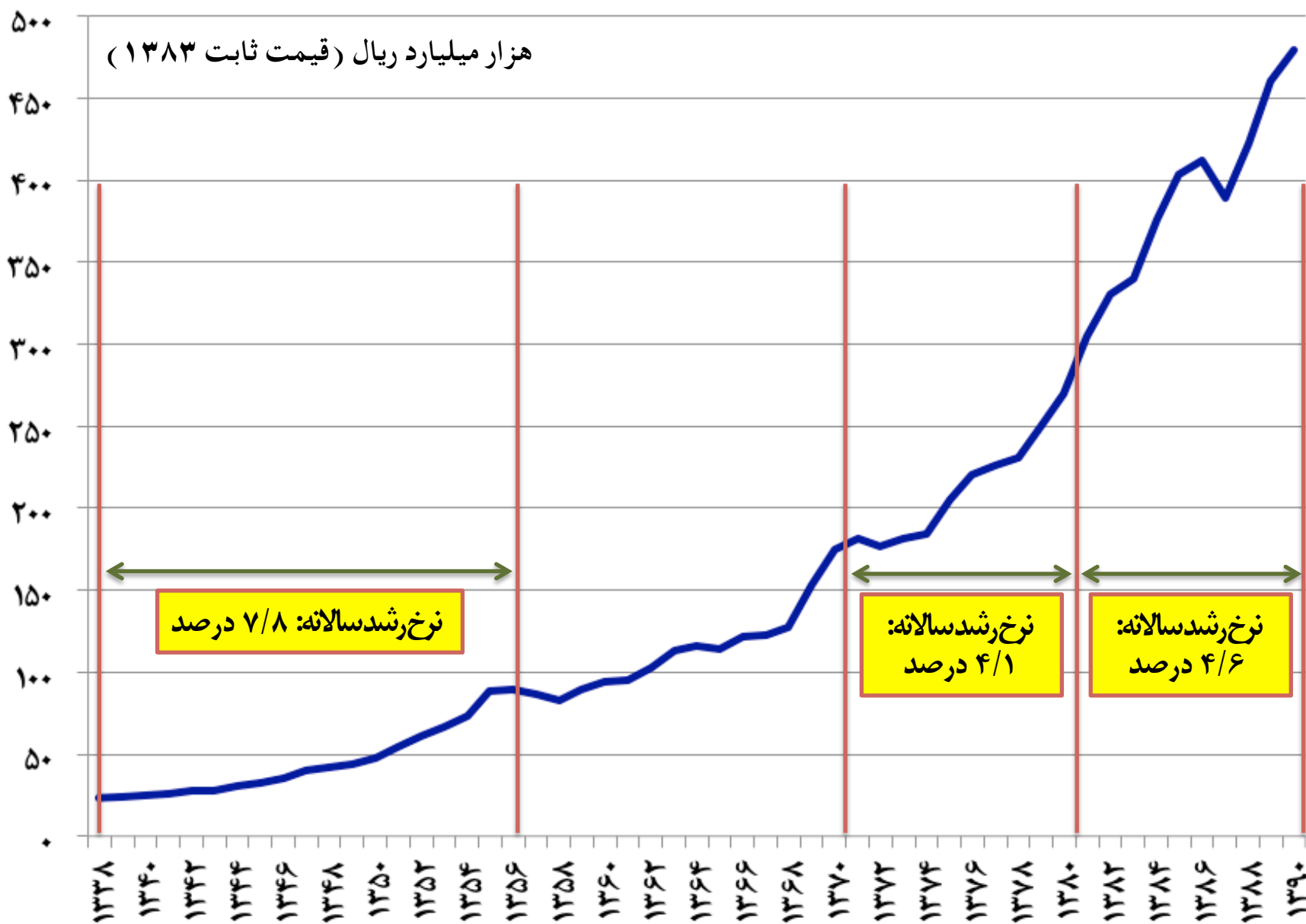


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های گمرک های ایران و امارات متحده عربی

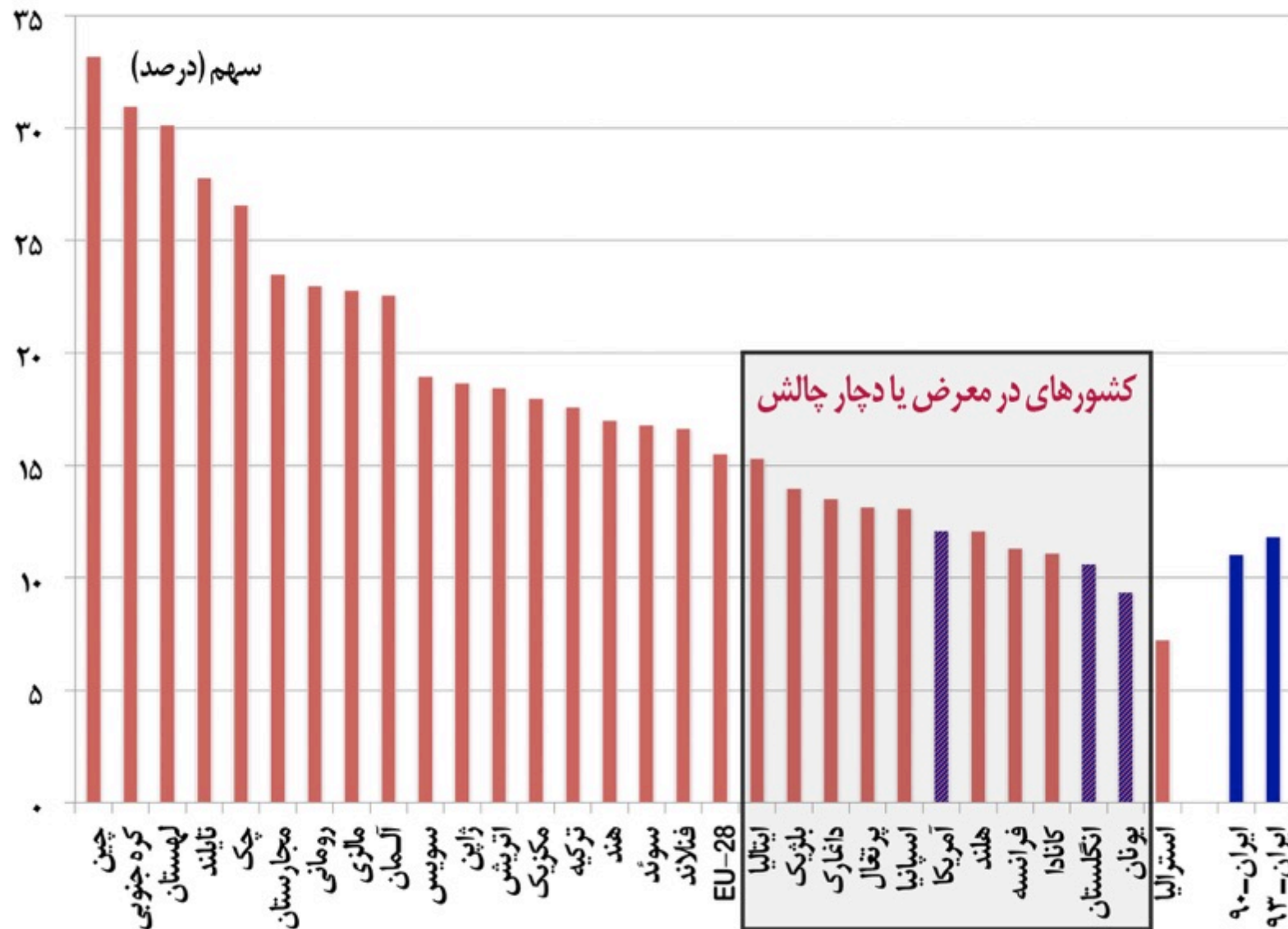
تولید و نرخ ارز



روند رشد تولید ناخالص داخلی بخش های تولیدی صنعت و کشاورزی

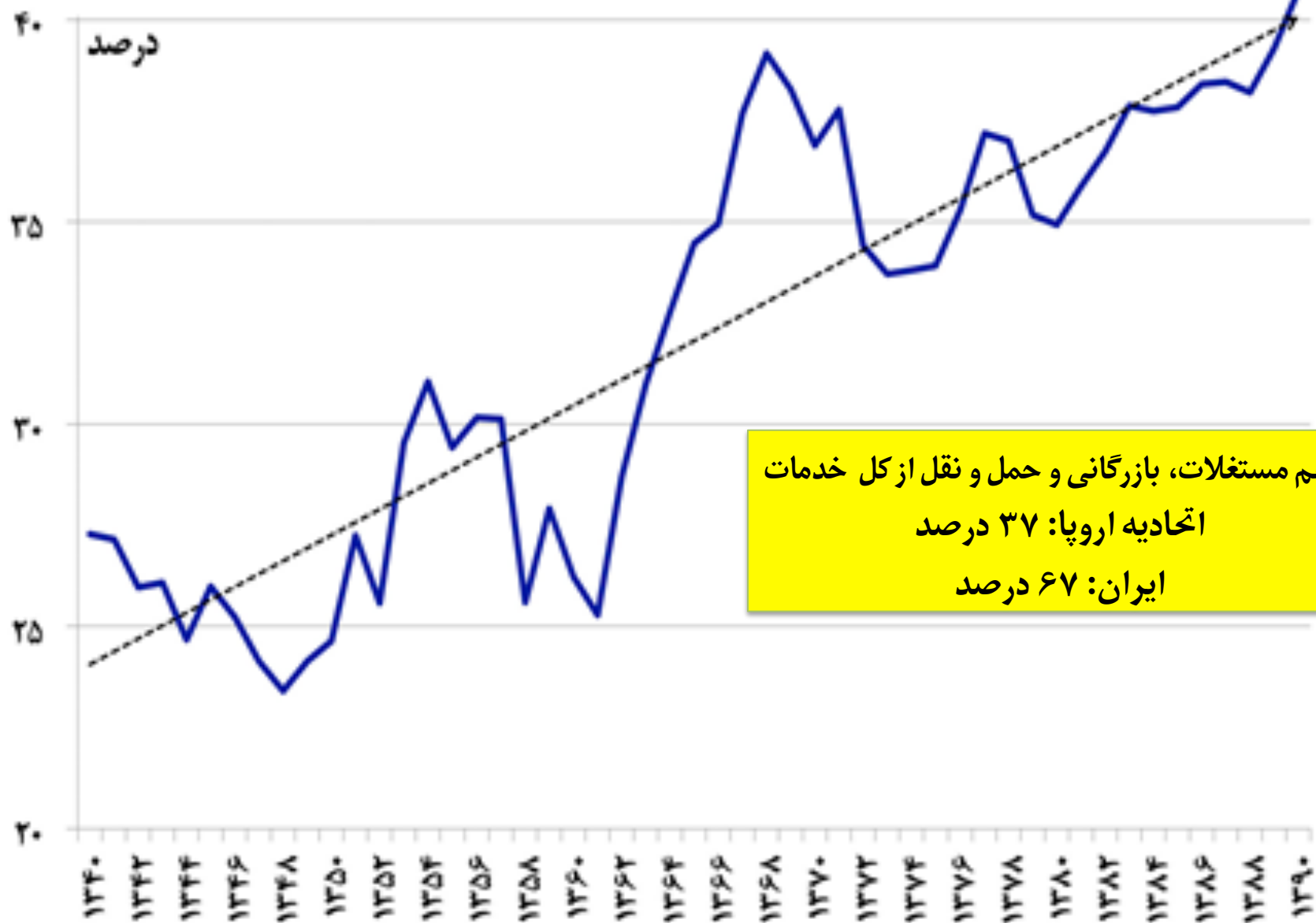


سهم بخش تولید صنعتی از درآمد اقتصادی کشورهای جهان و ایران

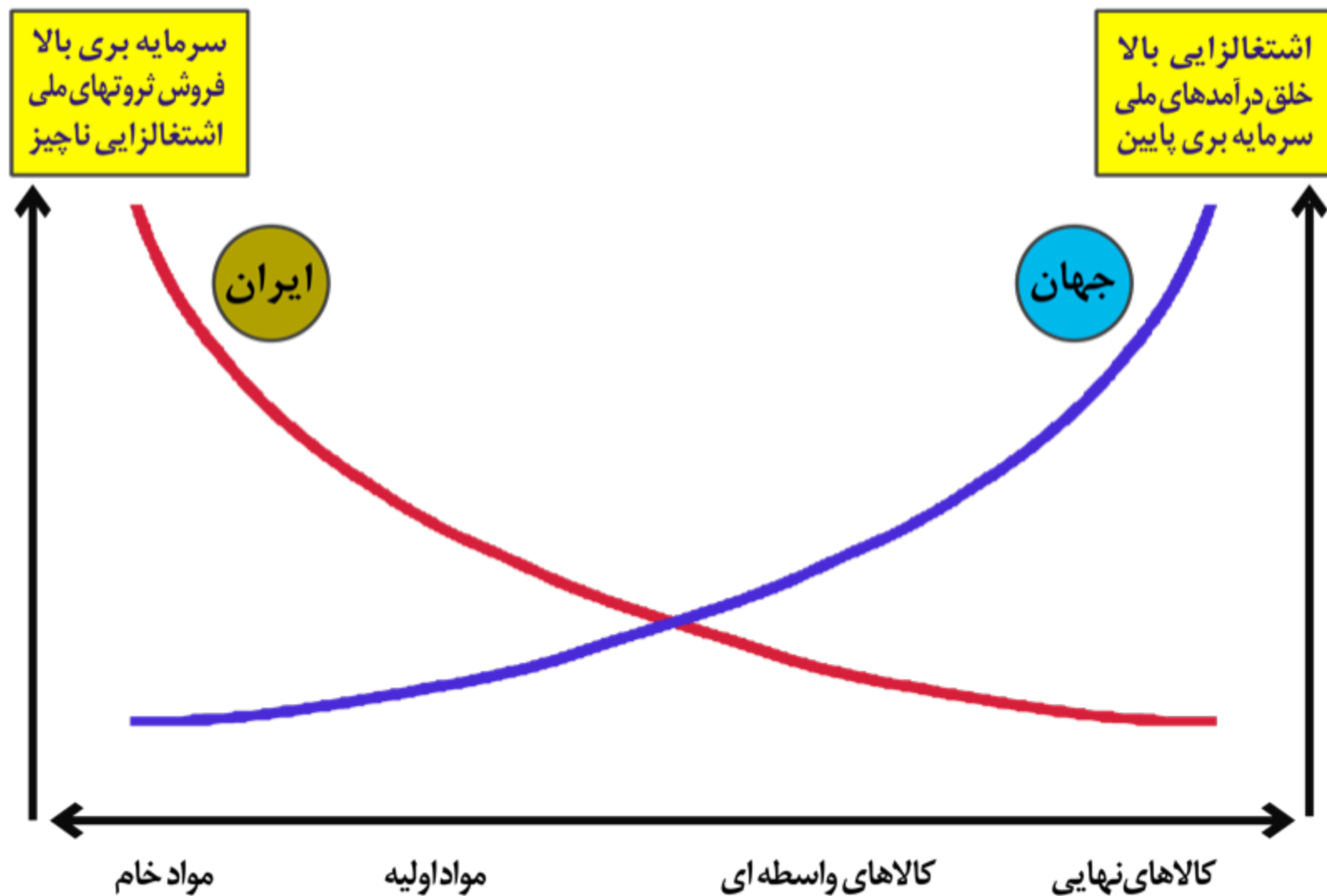


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های حساب های ملی کشورها

رشد سهم بخشهای خدماتی مستغلات، بازرگانی و بانکی از تولید ناخالص داخلی

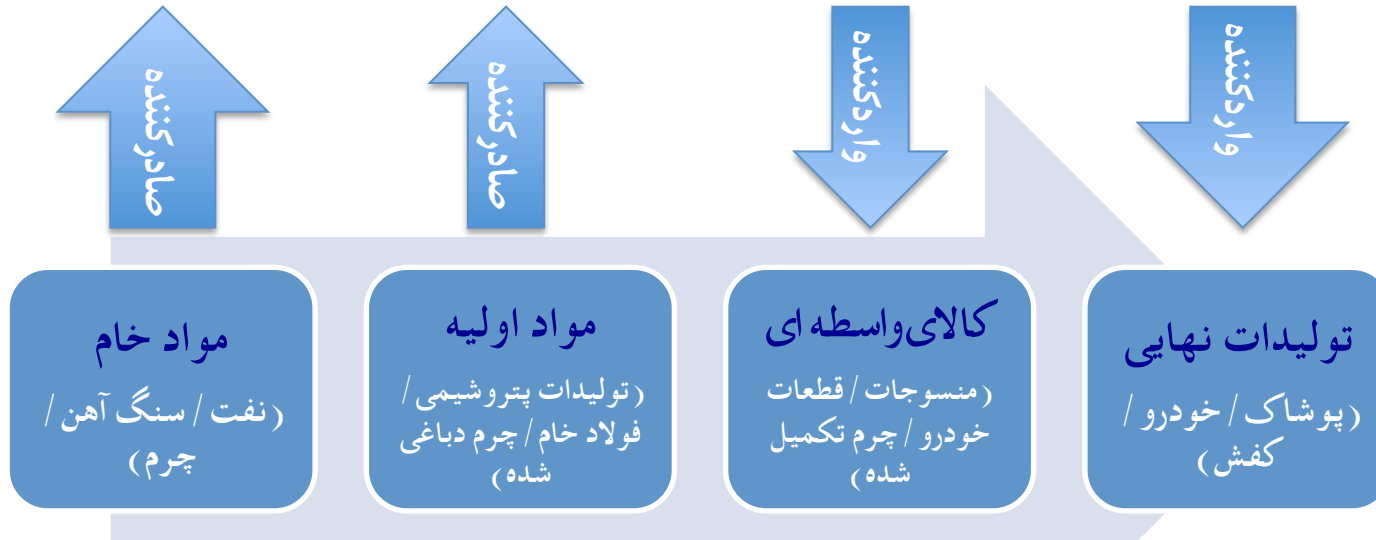


زنجیره ارزش تولید و صادرات در ایران و جهان



زنجیره ارزش صنعتی

وضعیت موجود
(خلاف وضعیت مطلوب)



صنایع بزرگ
اشتغالزایی پایین
ارزش افزوده پایین
سرمایه بری بالا
بخشهای غیر خصوصی

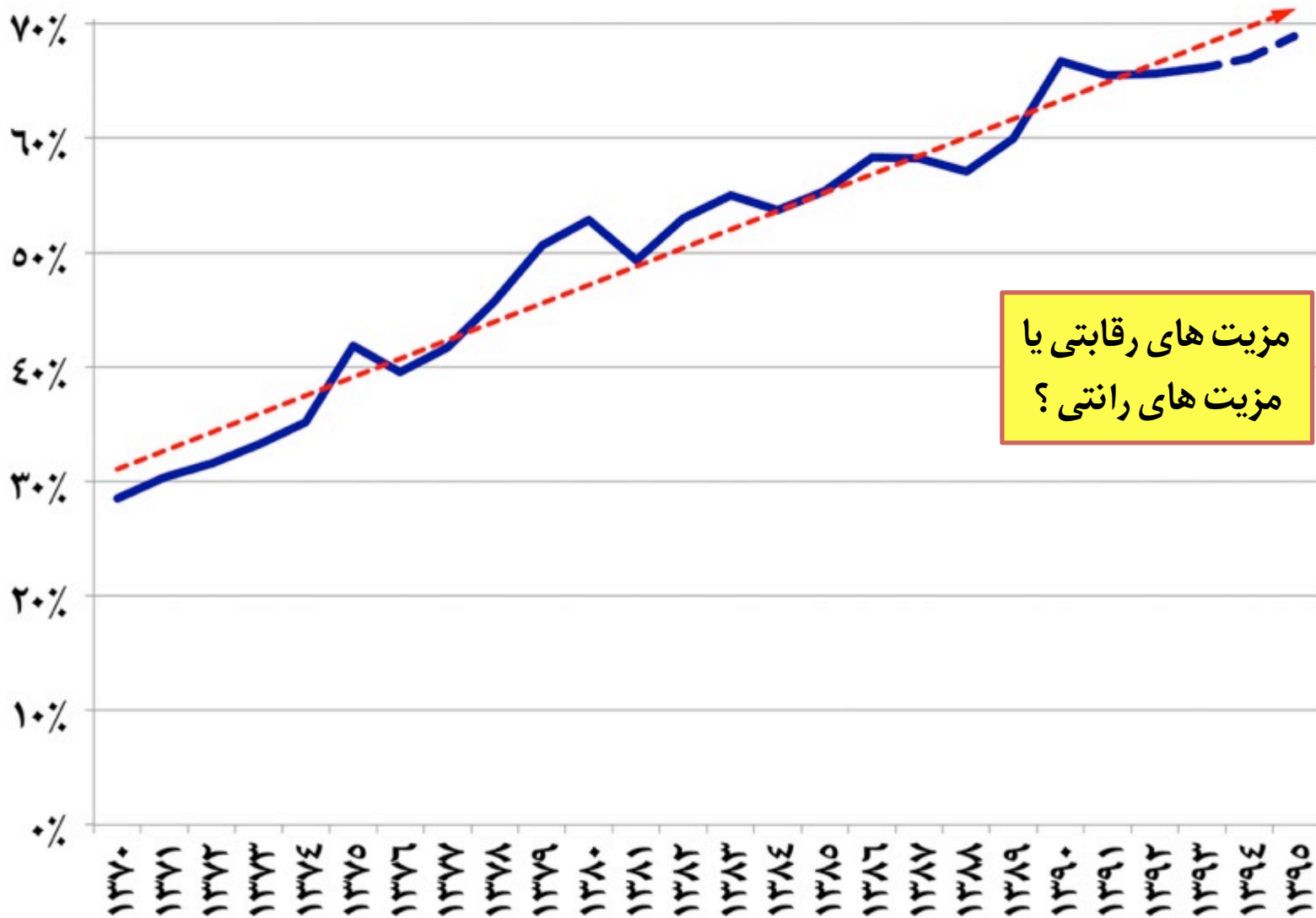
صنایع کوچک و متوسط
اشتغالزایی بالا
ارزش افزوده بالا
سرمایه بری پایین
بخش خصوصی

روند درست

روند توسعه صنعتی در کشورهای به تازگی توسعه یافته

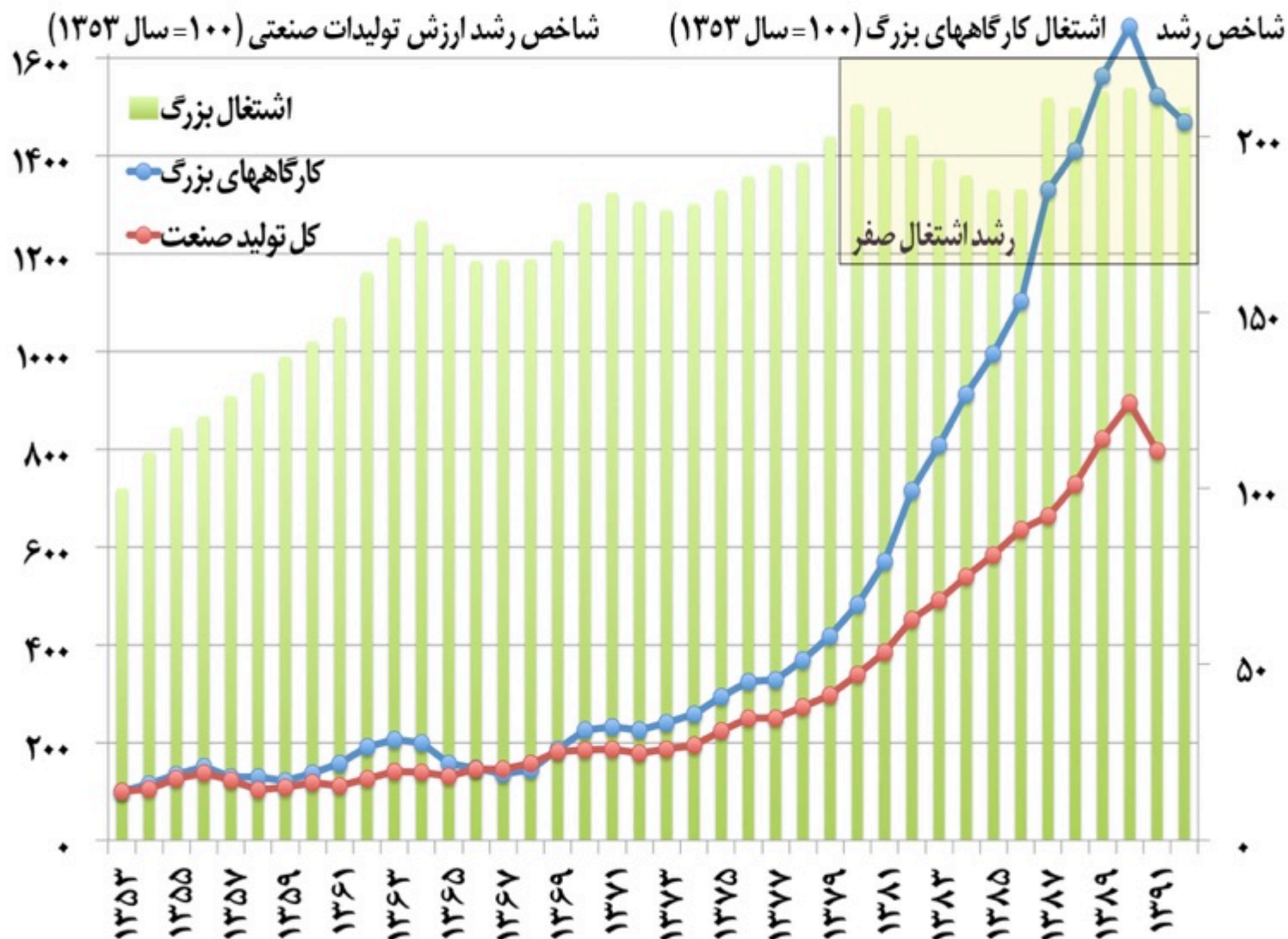


رشد سهم صنایع انرژی بر و بزرگ از درآمد صنعتی کشور



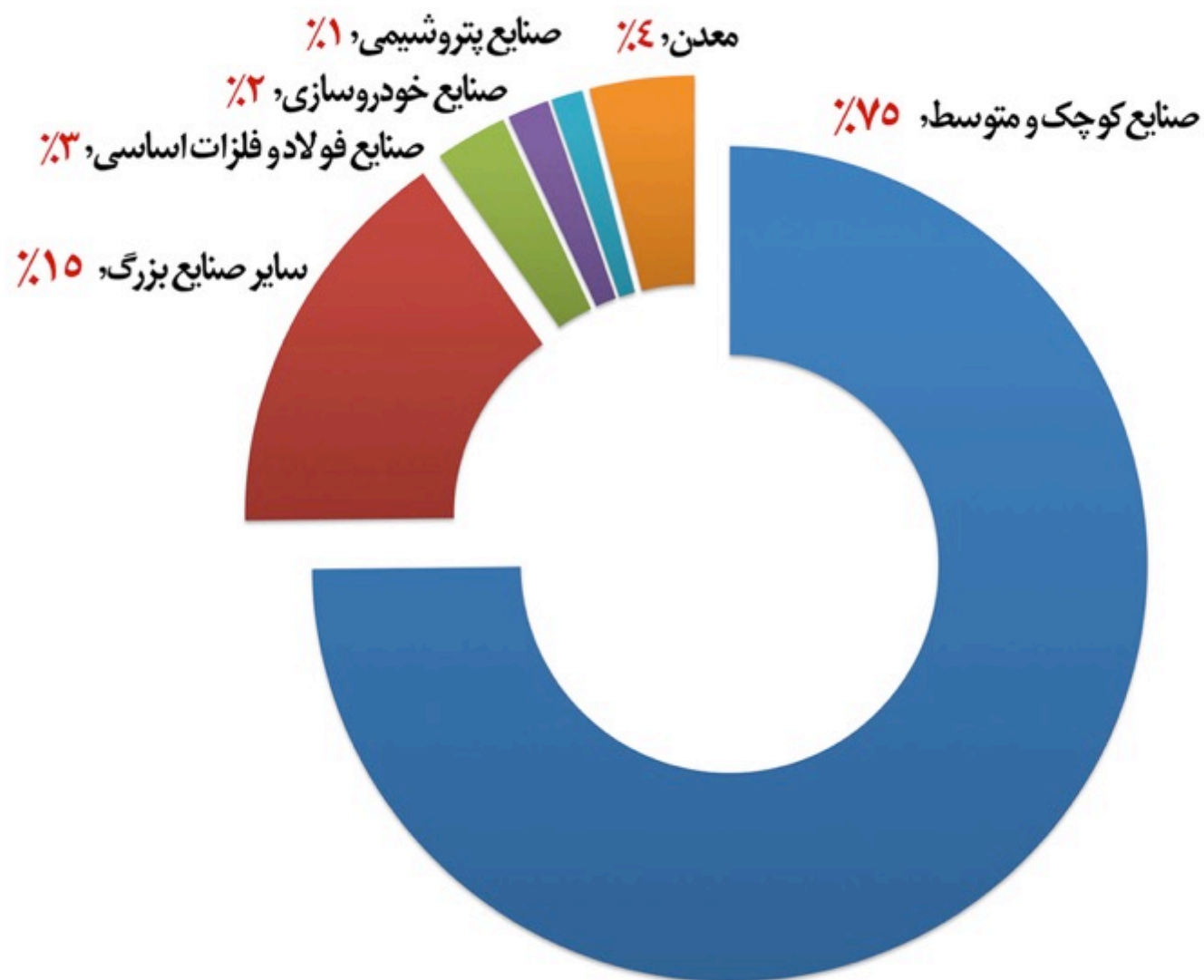
مزیت های رقابتی یا
مزیت های رانتی ؟

شاخص رشد تولیدات و اشتغال کارگاه های صنعتی بزرگ ایران

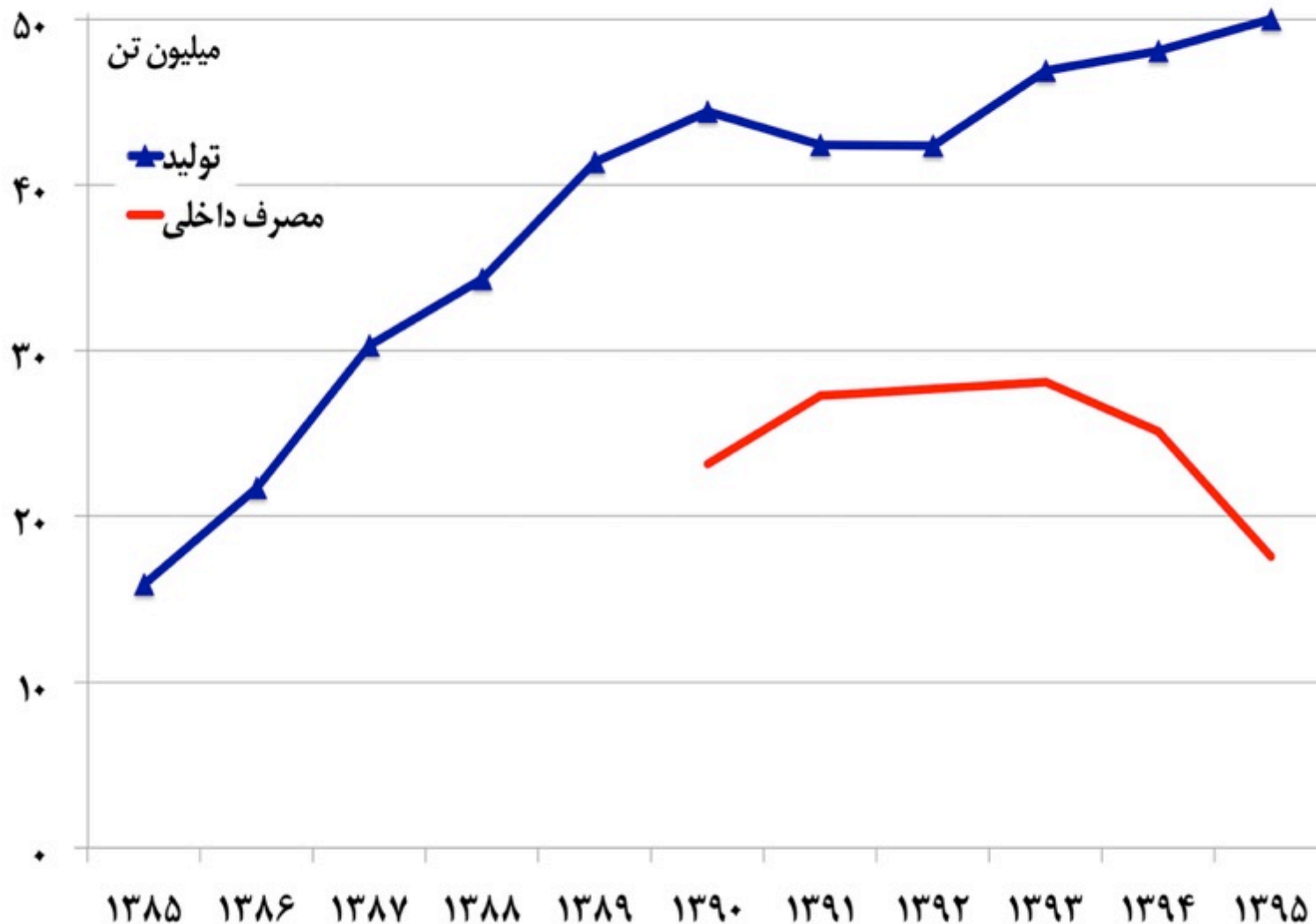


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی ایران

سهم صنایع کوچک و متوسط، صنایع بزرگ و معدن از کل اشتغال صنعت و معدن

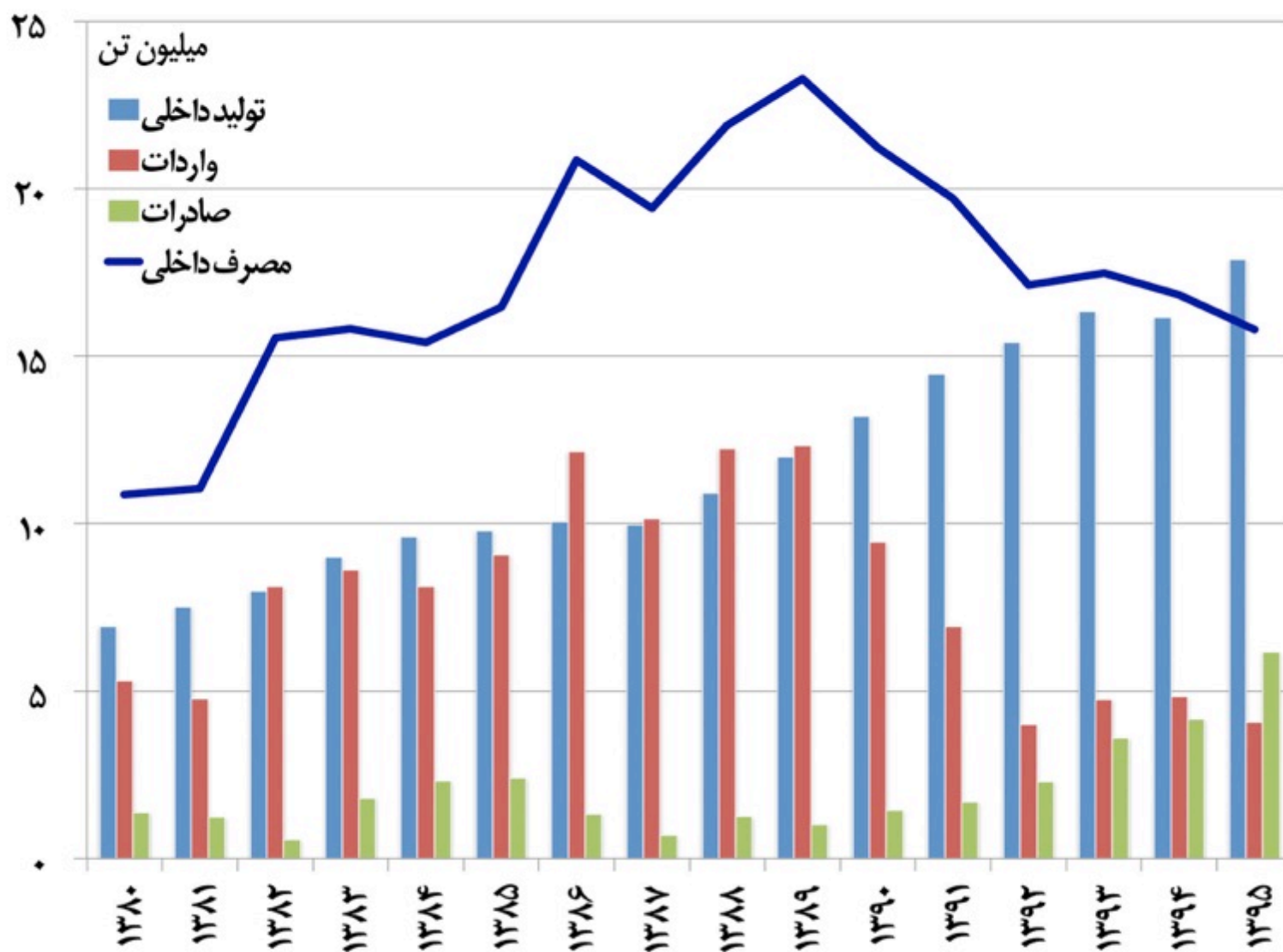


روند تولید و مصرف داخلی پتروشیمی ایران



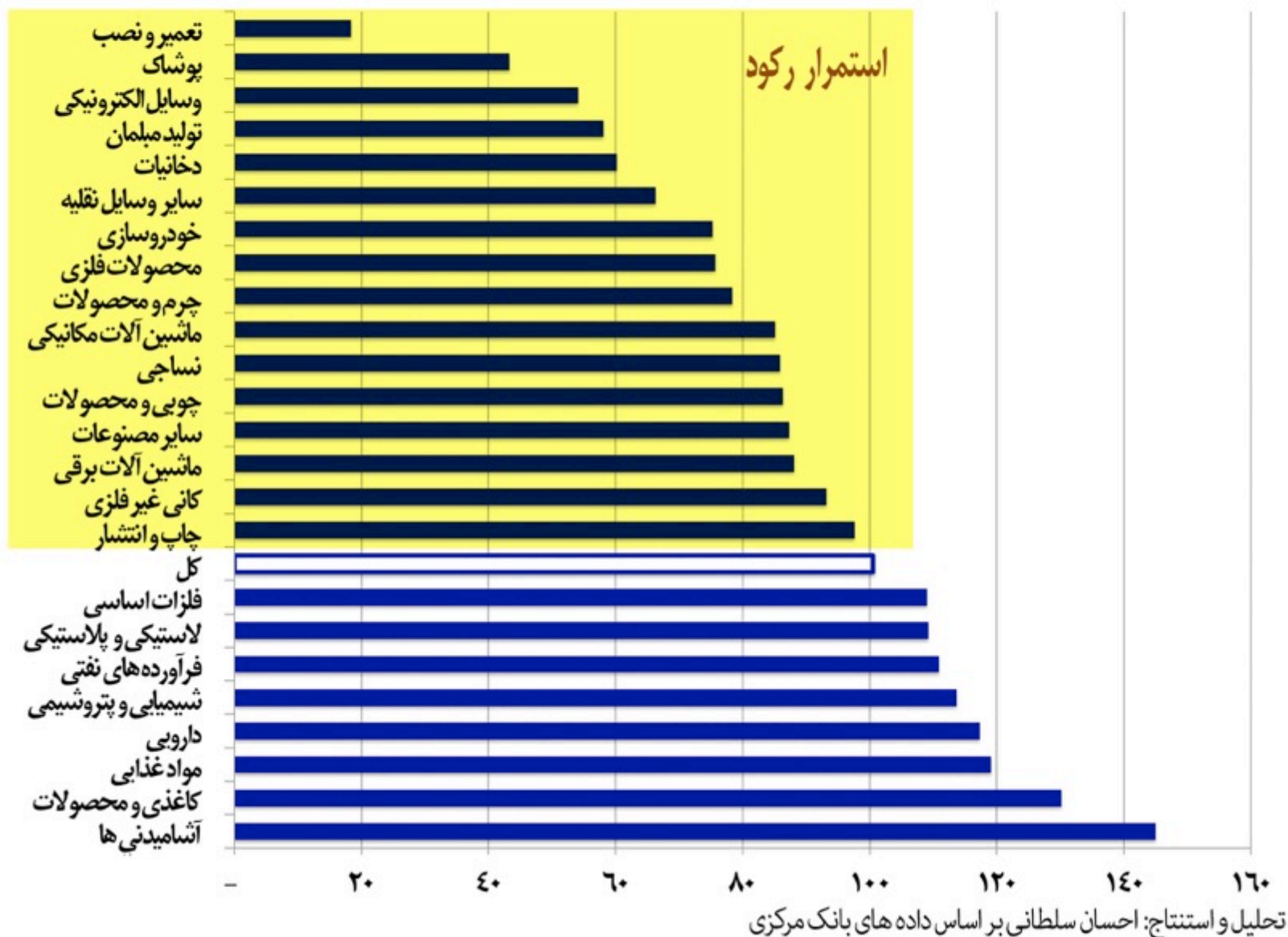
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های وزارت صنعت معدن و تجارت و بانک مرکزی

روند تولید، صادرات، واردات و مصرف داخلی آهن و فولاد ایران

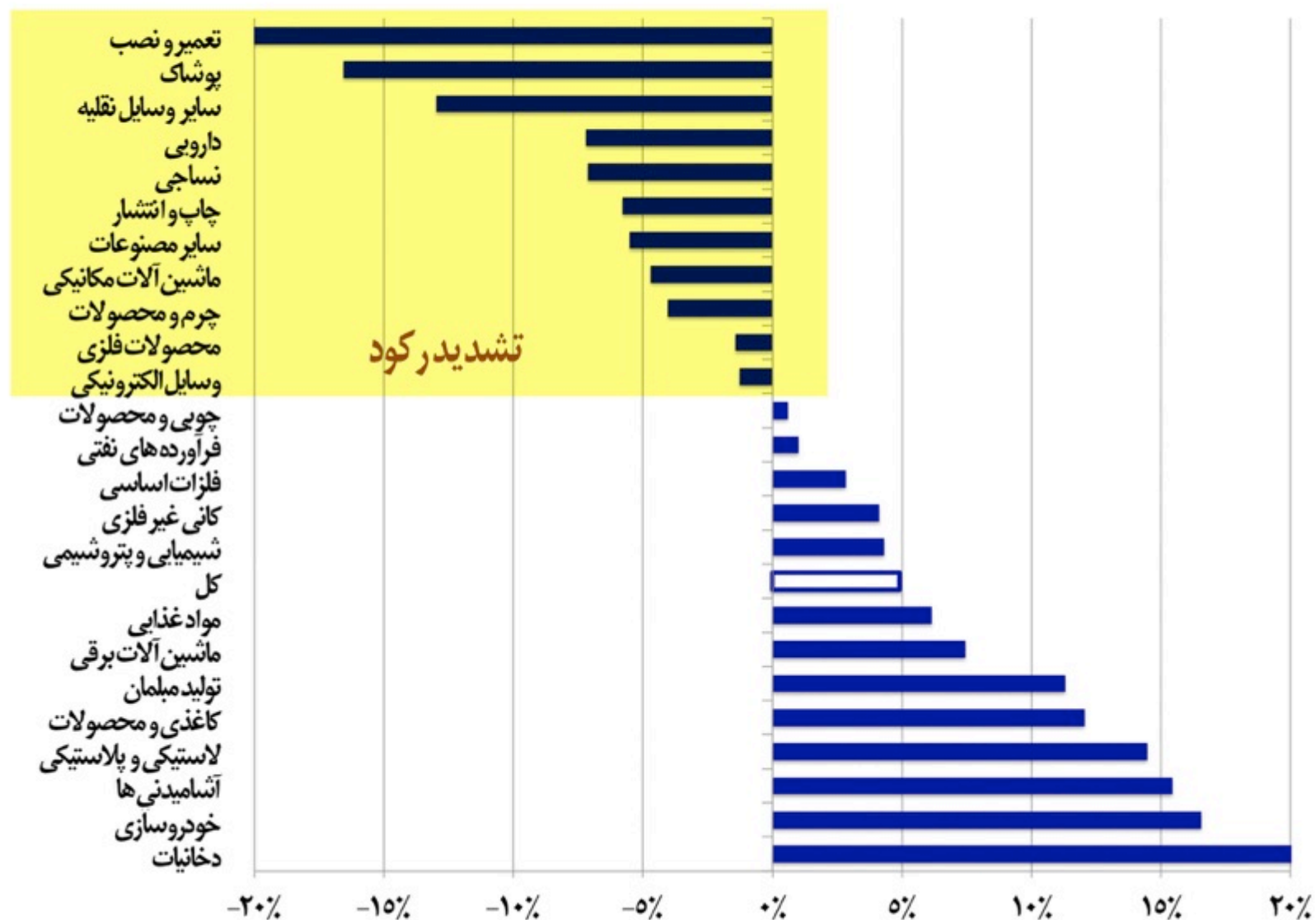


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های وزارت صنعت، معدن و تجارت، گمرک و بانک مرکزی

شاخص تولید کارگاه های بزرگ صنعتی در شش ماهه اول سال ۱۳۹۶ (۱۰۰ = سال ۱۳۹۰)



تغییرات شاخص تولید کارگاه های بزرگ صنعتی در شش ماهه اول سال ۱۳۹۶ نسبت به سال ۱۳۹۵

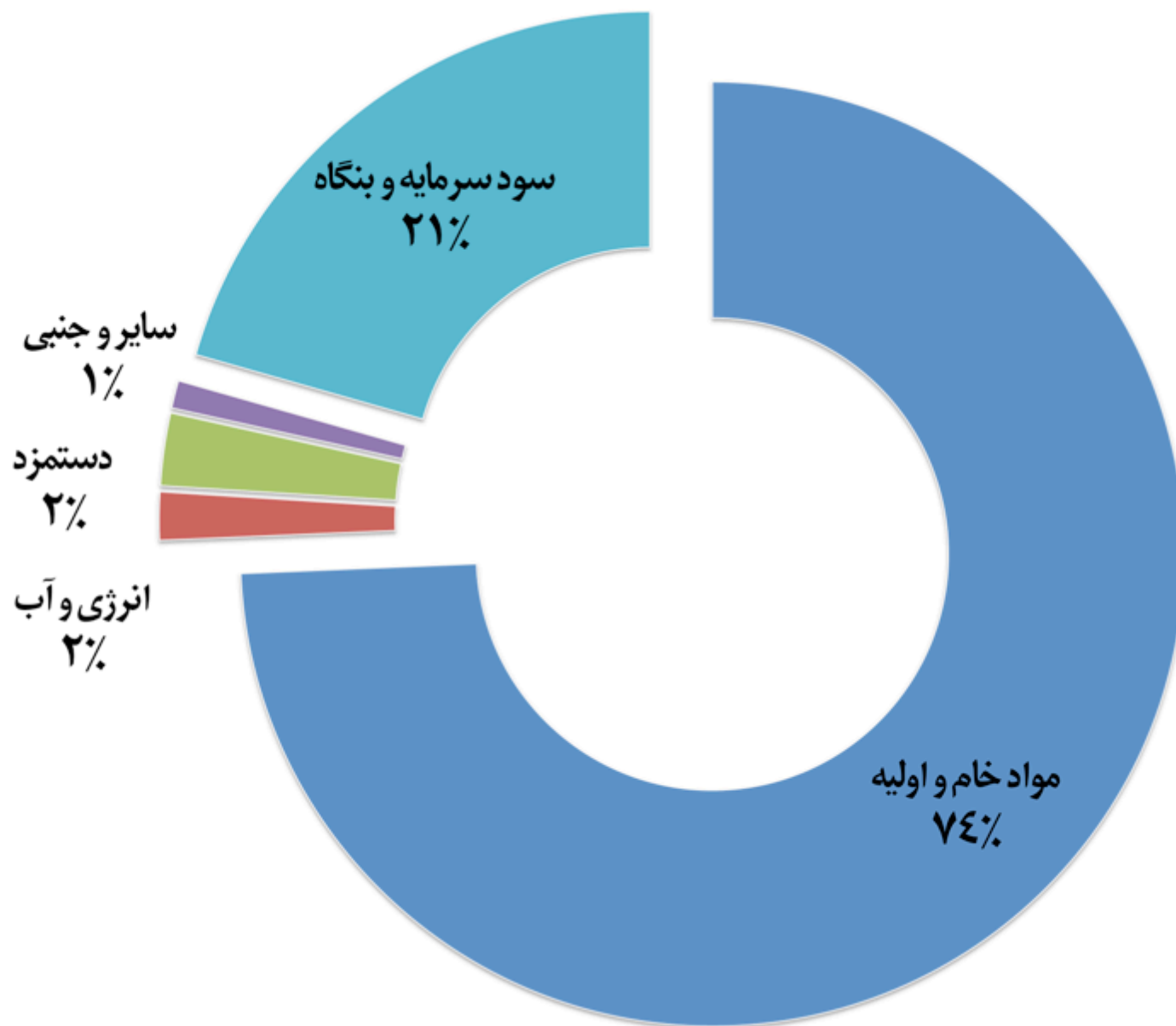


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی

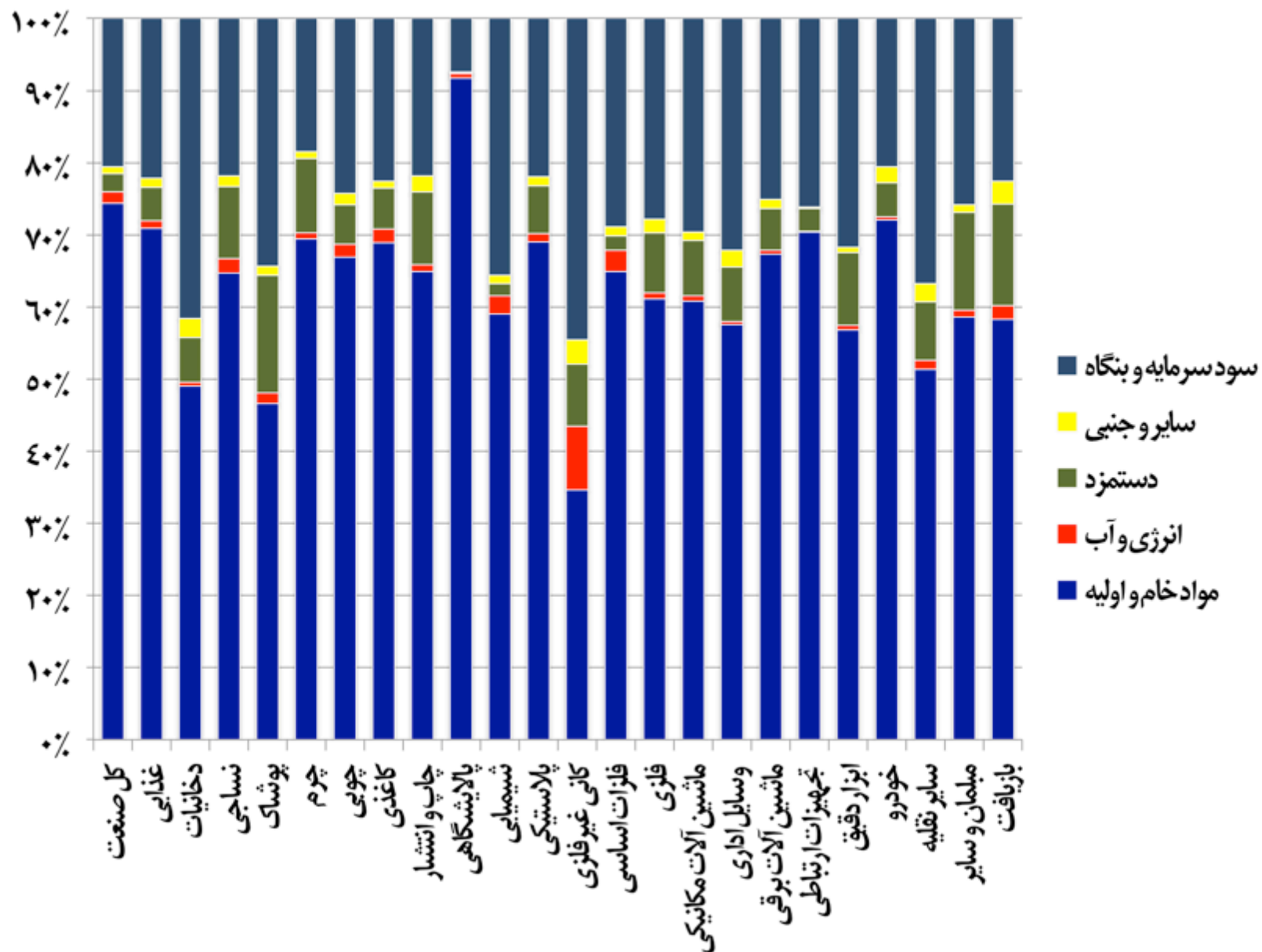
عوامل کلیدی و اصلی قیمت تمام شده تولید



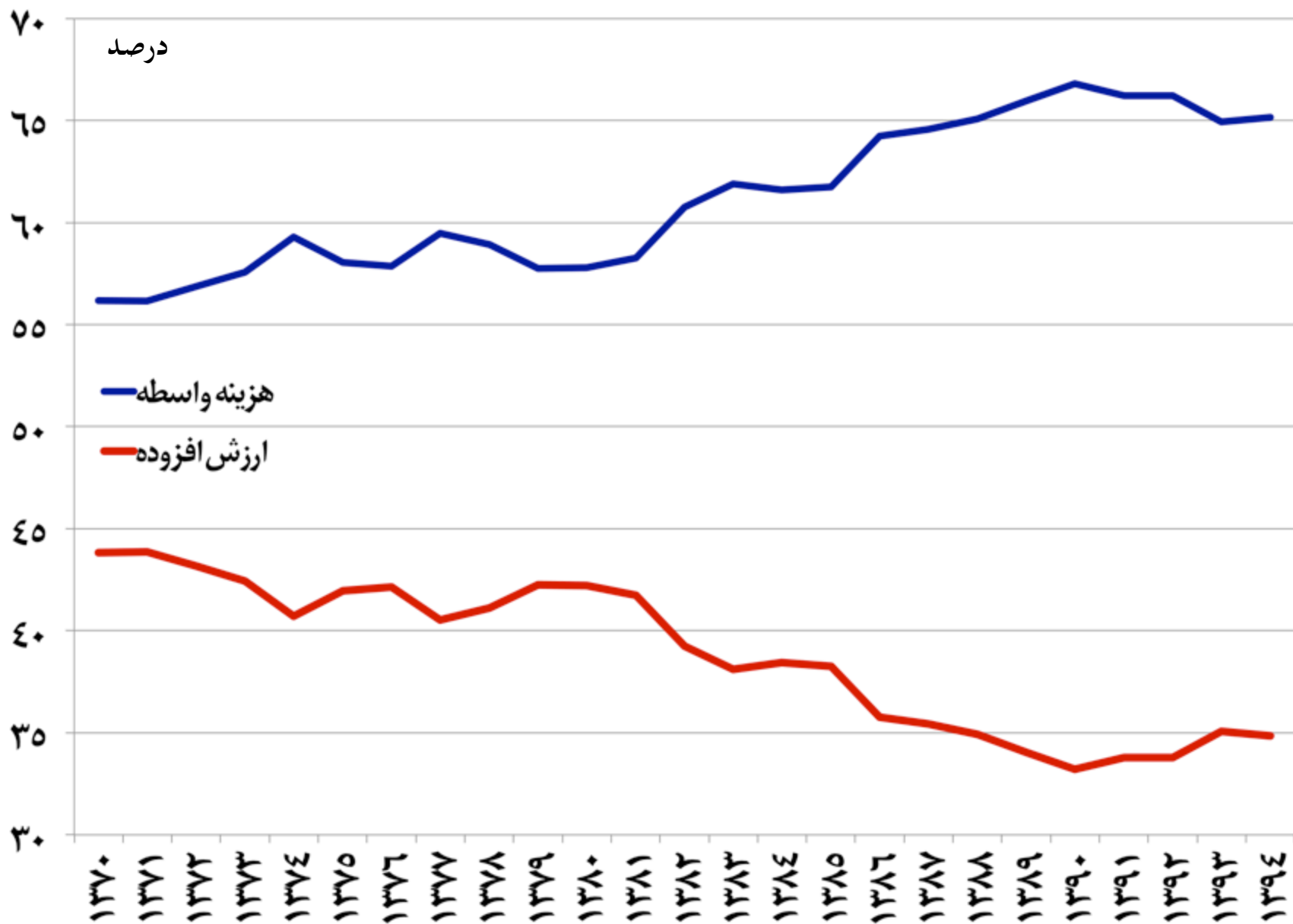
اجزای قیمت فروش تولیدات کل کارگاه های صنعتی با ۱۰ نفر کارکن و بیشتر



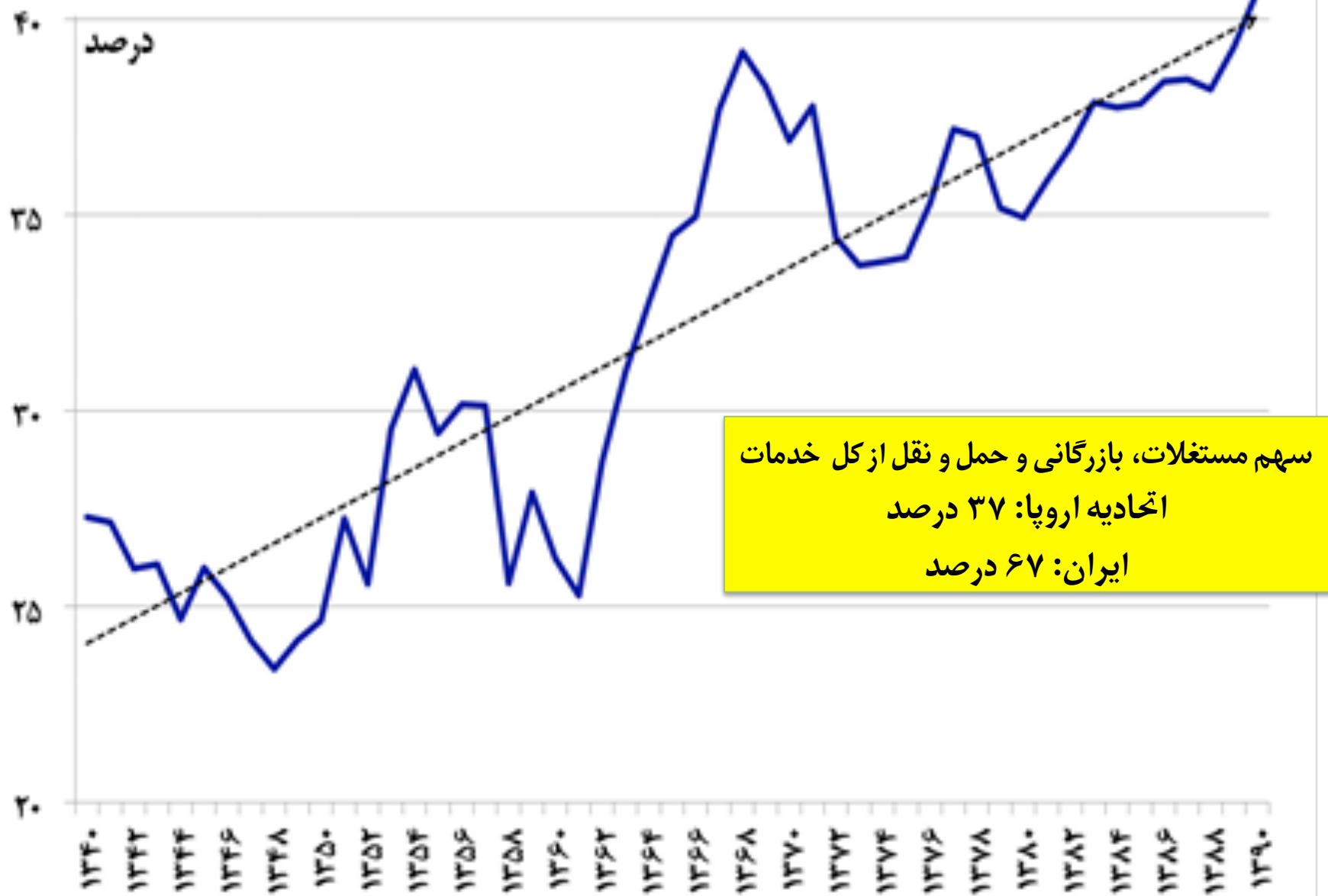
اجزای قیمت فروش تولیدات کارگاه های صنعتی با ۱۰ نفر کارکن و بیشتر



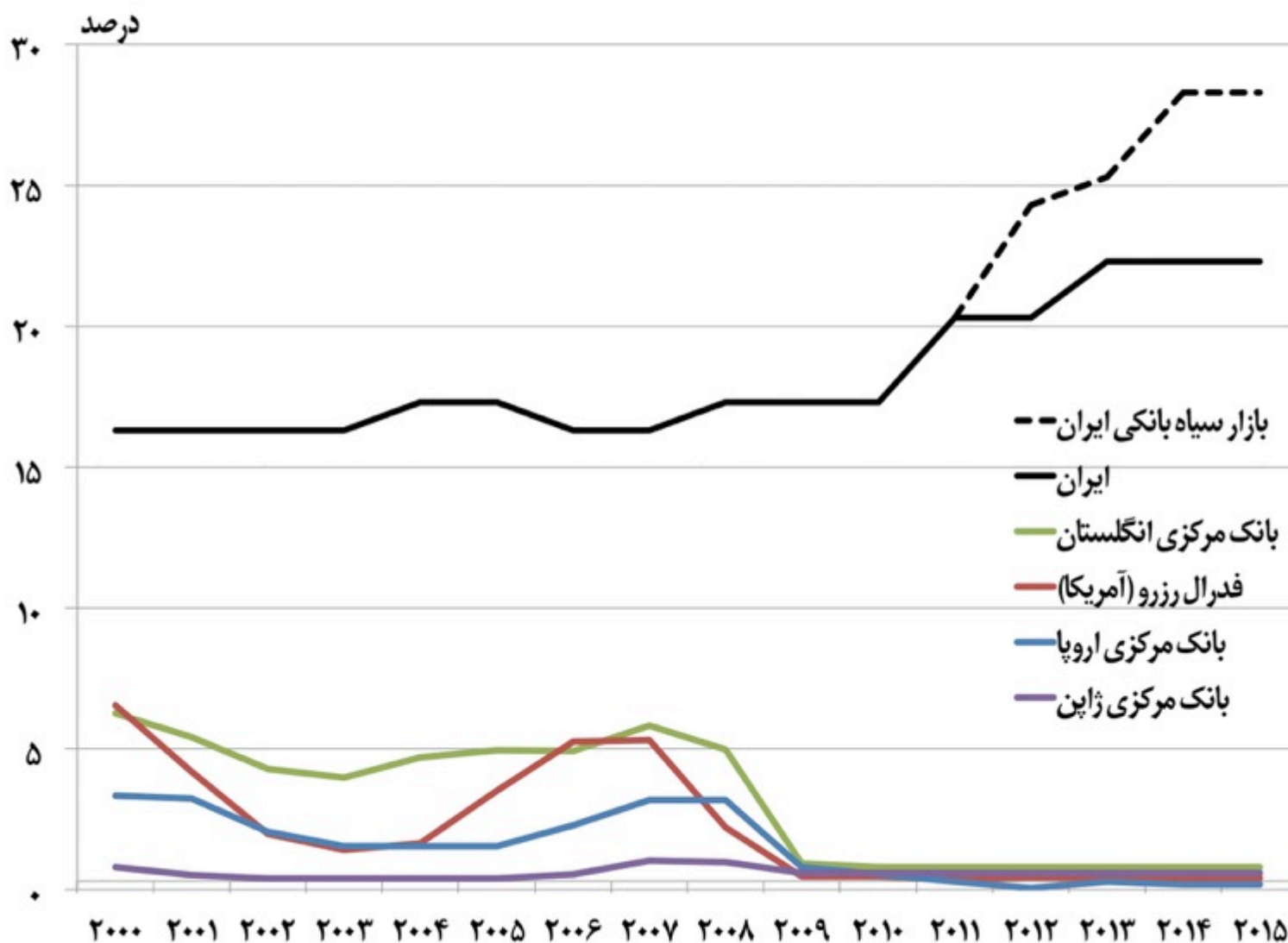
سهم هزینه واسطه و ارزش افزوده از کل ارزش تولید صنعتی ایران



رشد سهم بخشهای خدماتی مستغلات، بازرگانی و بانکی از تولید ناخالص داخلی

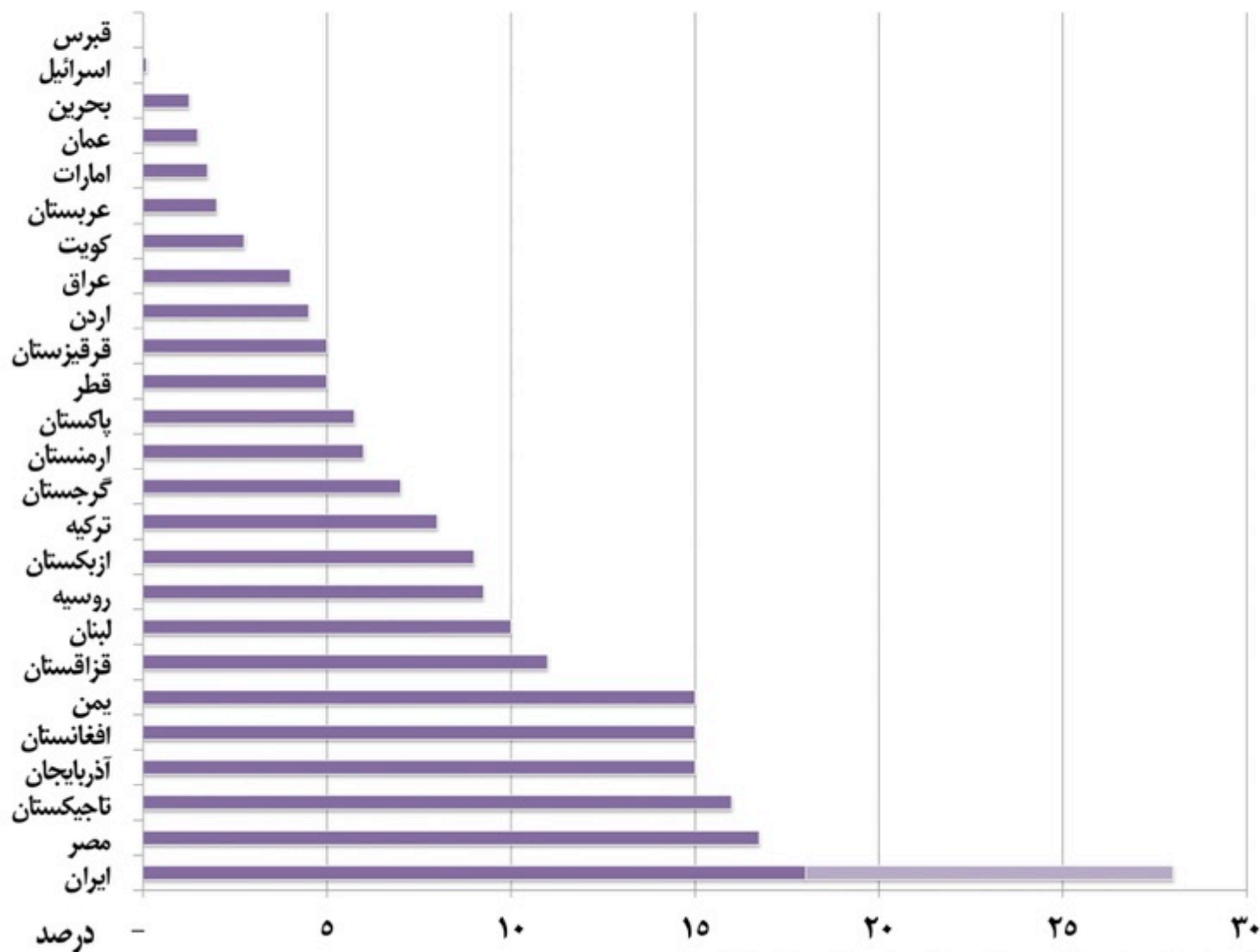


روند نزولی نرخ سود بانکی در اقتصادهای مهم جهان و نرخ صعودی در ایران



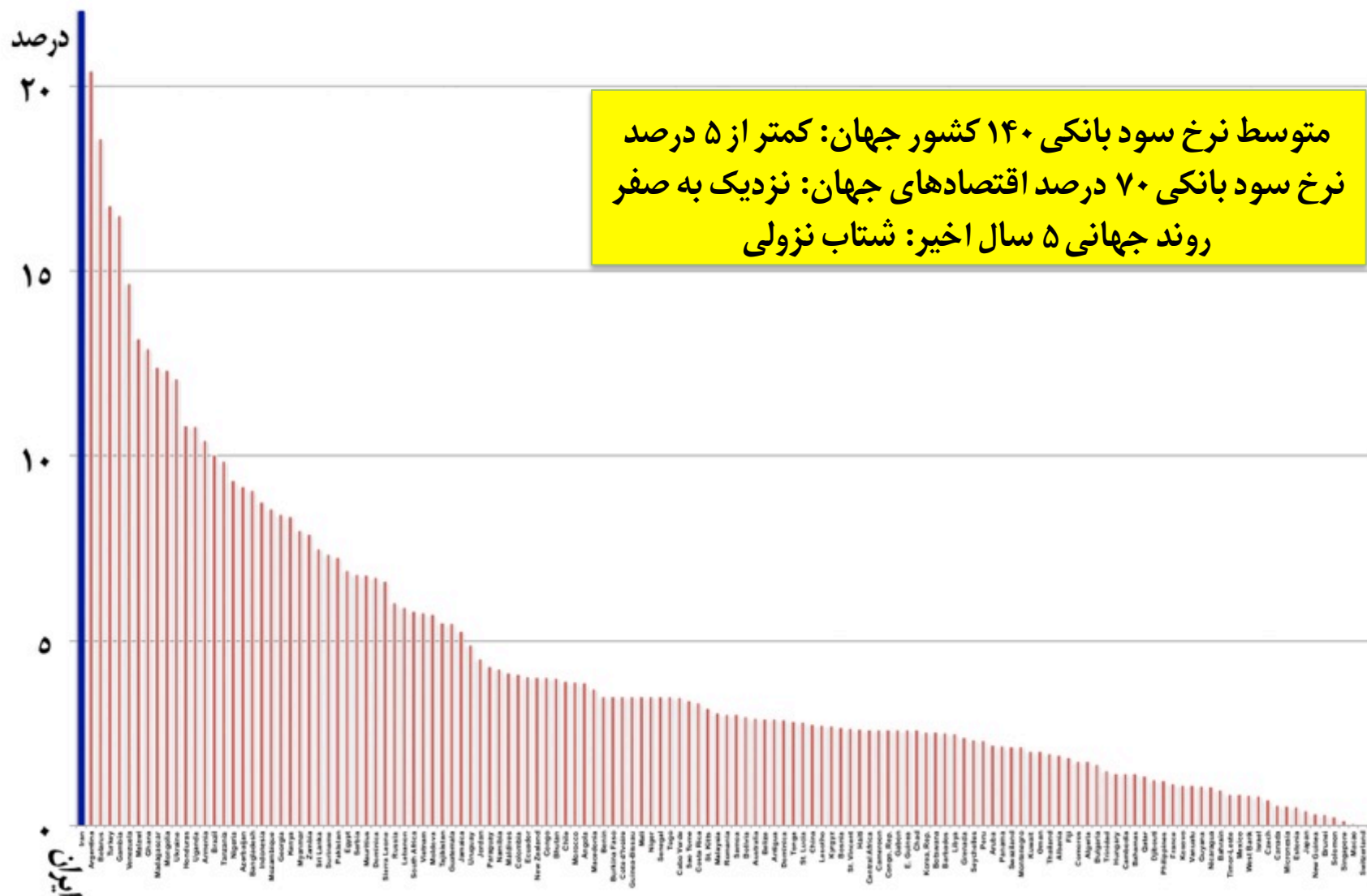
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی کشورها

نرخ سود بانکی در ایران و کشورهای منطقه (۱۳۹۵)



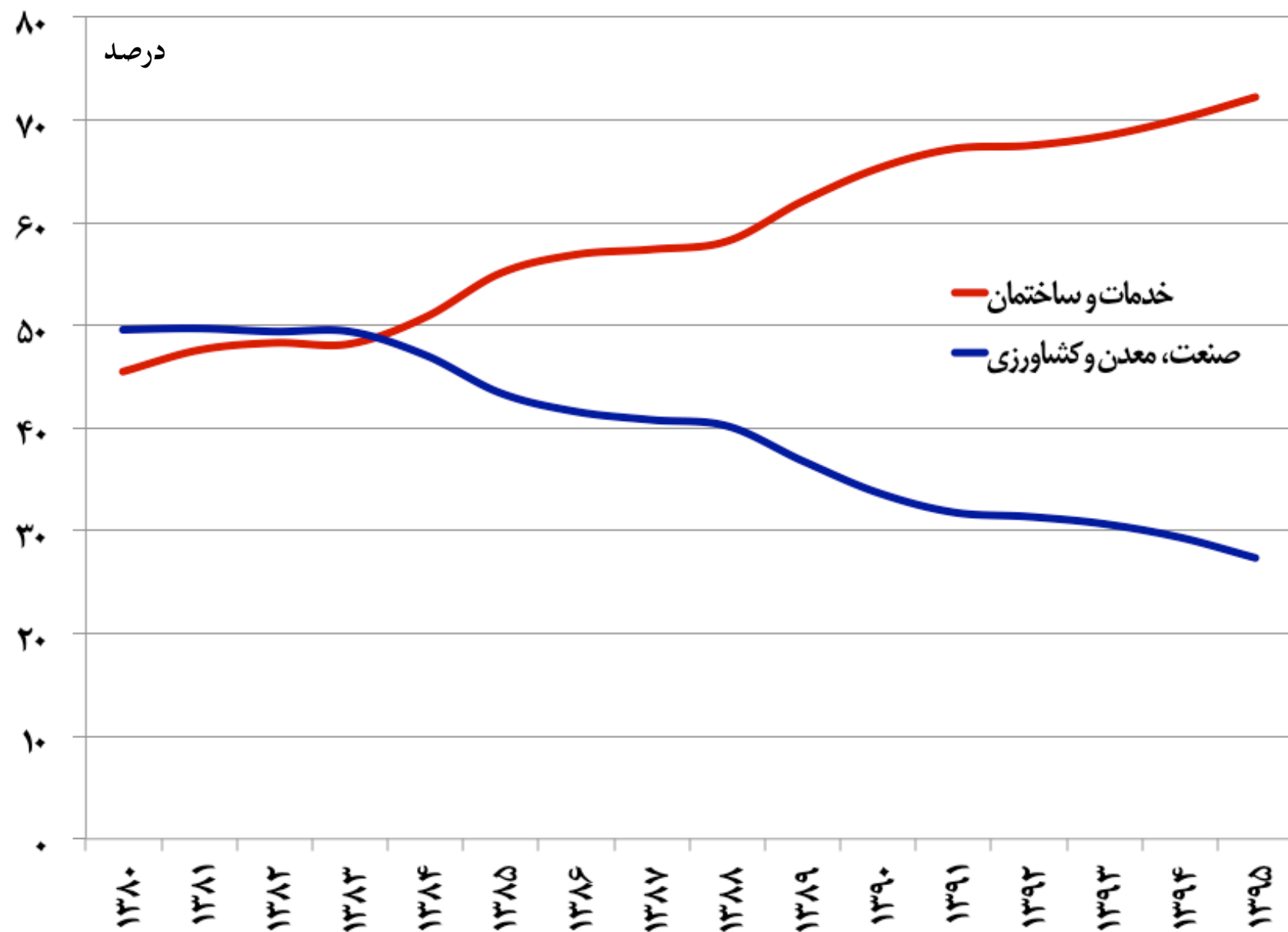
تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی کشورها

نرخ سود سپرده های بانکی در ایران و کشورهای جهان (۲۰۱۴/۱۳۹۴)



تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک جهانی

سهم بخش های اقتصادی از مانده تسهیلات بانکی

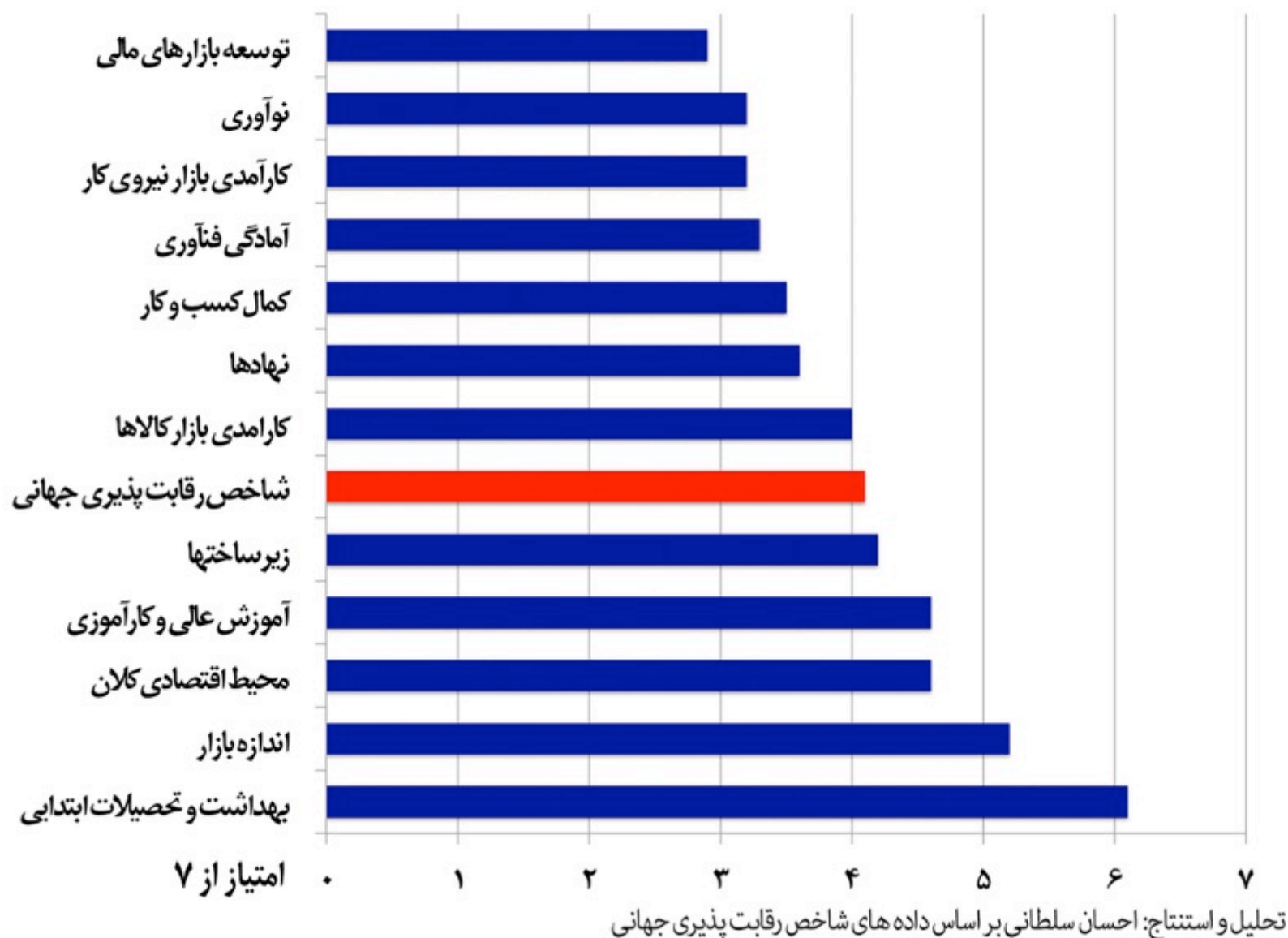


مهمترین مشکلات کسب و کار در ایران (۲۰۱۶ میلادی)



تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های شاخص رقابت پذیری جهانی

عملکرد ایران در شاخصهای رقابت پذیری جهانی (۲۰۱۶ میلادی)



نقش افزایش نرخ ارز بر روی تولید صنعتی

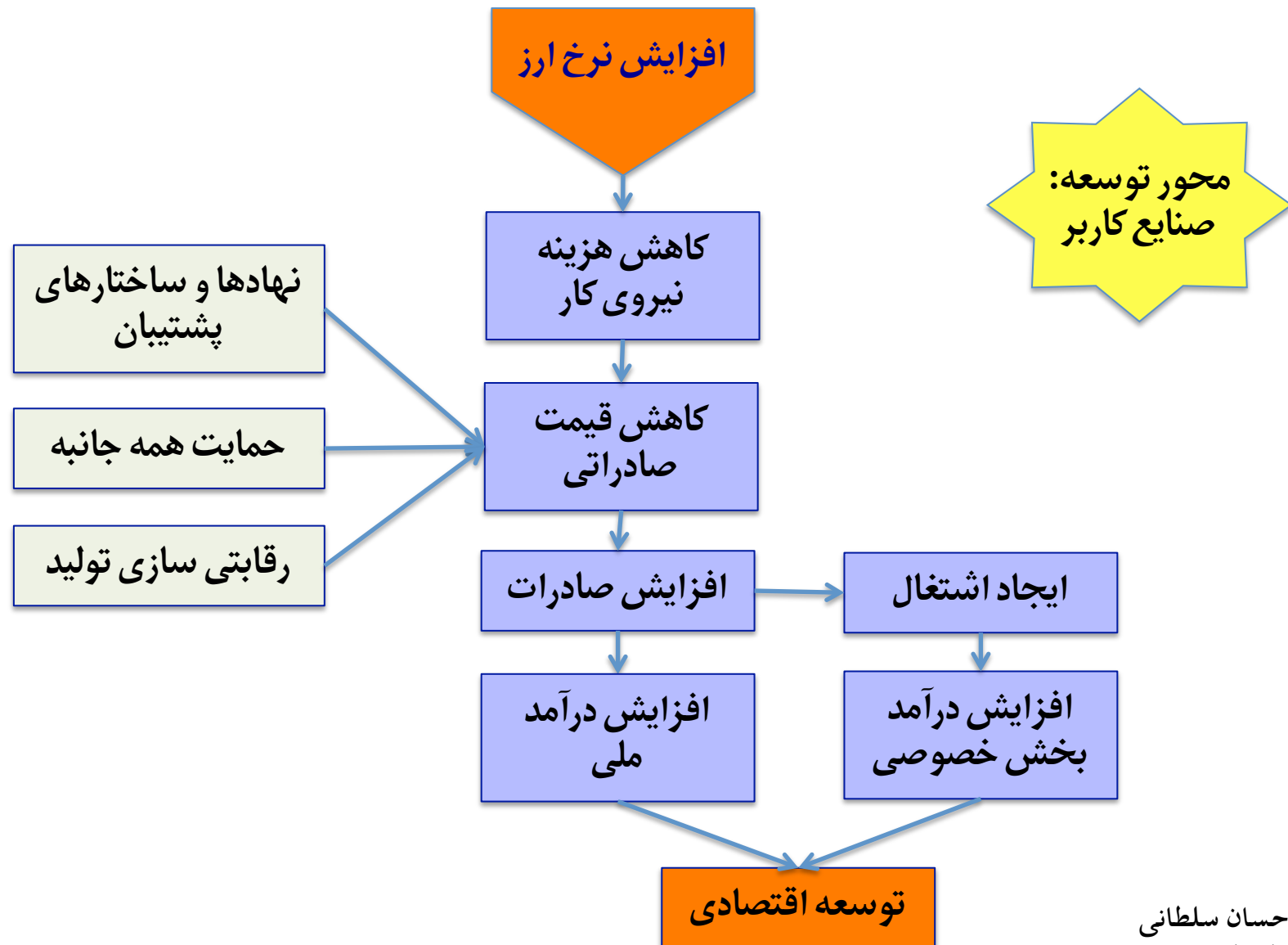
در اقتصاد ایران بخش اصلی قیمت تمام شده تولید کارخانه ای مربوط به مواد اولیه و خام می باشد. صعود نرخ ارز، افزایش رانت مواد خام و اولیه را به دنبال دارد که بنا به سنت مالوف نصیب صنایع بالا دستی -رانتی می شود. از سوی دیگر در شرایط کنونی، افزایش هزینه تولید صنایع پایین دستی (با توجه به بالا رفتن بهای مواد اولیه)، تشدید رکود و زیان دهی و تعطیلی این صنایع را در پی دارد.

در اقتصادهایی که ایجاد ارزش افزوده تولید متکی به نیروی کار باشد، در صورت وجود استراتژی های صادراتی ارزش-افزوده محور و نهادها و ساختارهای پشتیبان نیروهای مولد، سیاست افزایش نرخ ارز می تواند در مقاطع اولیه توسعه برای رشد صادرات و تولید مفید واقع شود. باید توجه داشت که این سیاستگذاری ها در سطح محدودی می توانند مفید واقع شوند، زیرا اگر استمرار پیدا کنند یا شدت آنها زیاد باشد منجر به مهاجرت نیروی کار نخبه/ماهر یا خروج آنها از فعالیت های مولد و کاهش انگیزه در بخش تولید می شود. سیاست افزایش نرخ ارز برای حمایت از تولید اصولاً معطوف و متمرکز به حمایت از صنایع پایین دستی صادراتی است و نه صنایع مادر بالادستی. افزایش نرخ ارز در اقتصاد ایران، یارانه ای است که دولت به صنایع بالادستی رانتی ناکارآمد خصولتی (که خود آنها را ایجاد کرده است و عملاً اداره می کند) می دهد.

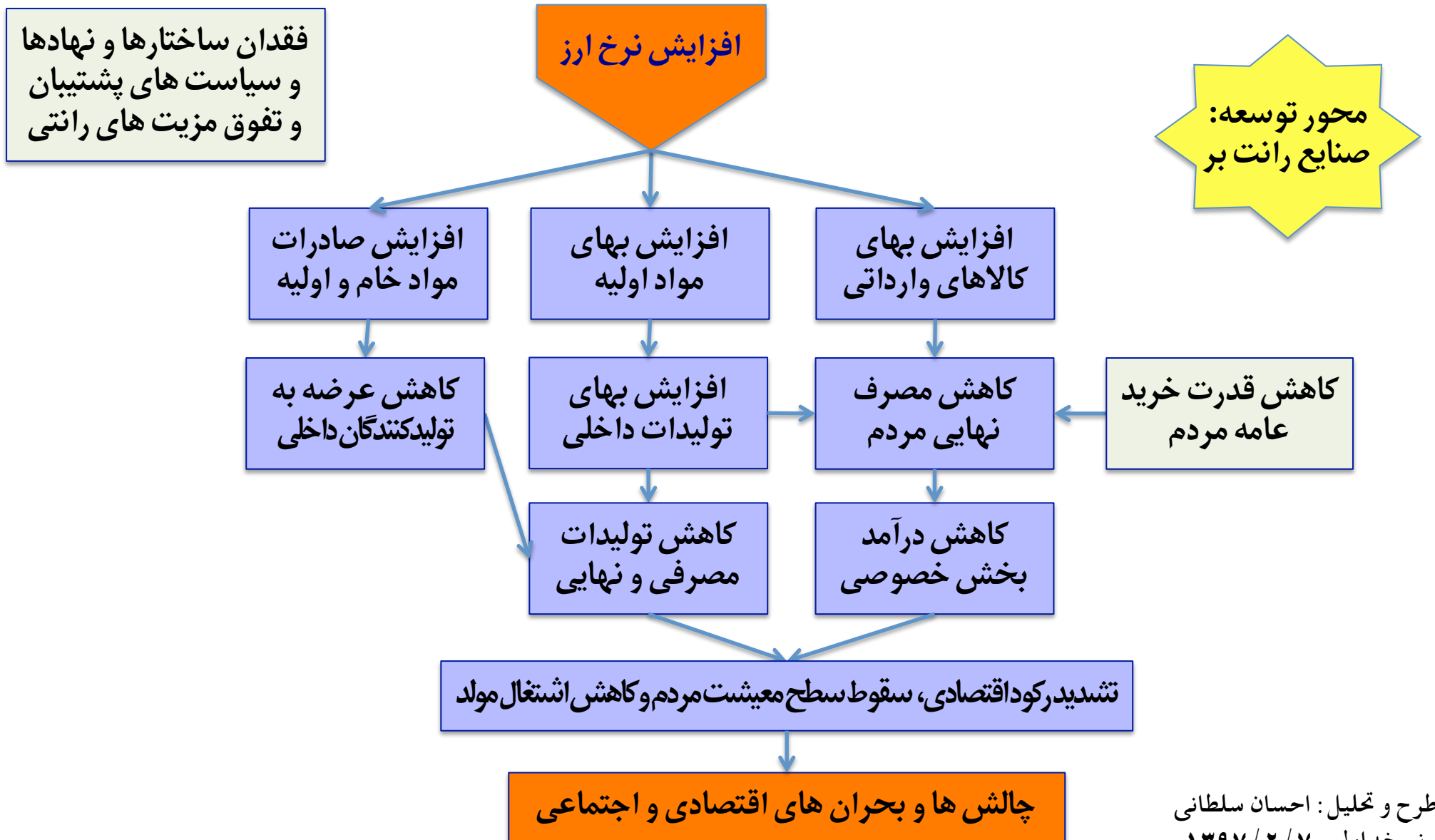
«باران که در لطافت طبعش خلاف نیست، در باغ لاله روید و در شوره زار خس»

هر چند که افزایش نرخ ارز که در بعضی مقاطع در بعضی اقتصادها منجر به توسعه صنایع کاربر می شود، اما در اقتصاد رانتی و نامولد ایران و در غیاب نهاد و ساختارهای پشتیبان نیروهای مولد، در عمل نتیجه عکس به همراه داشته و تقویت بخش های نامولد و رانتی را به دنبال دارد.

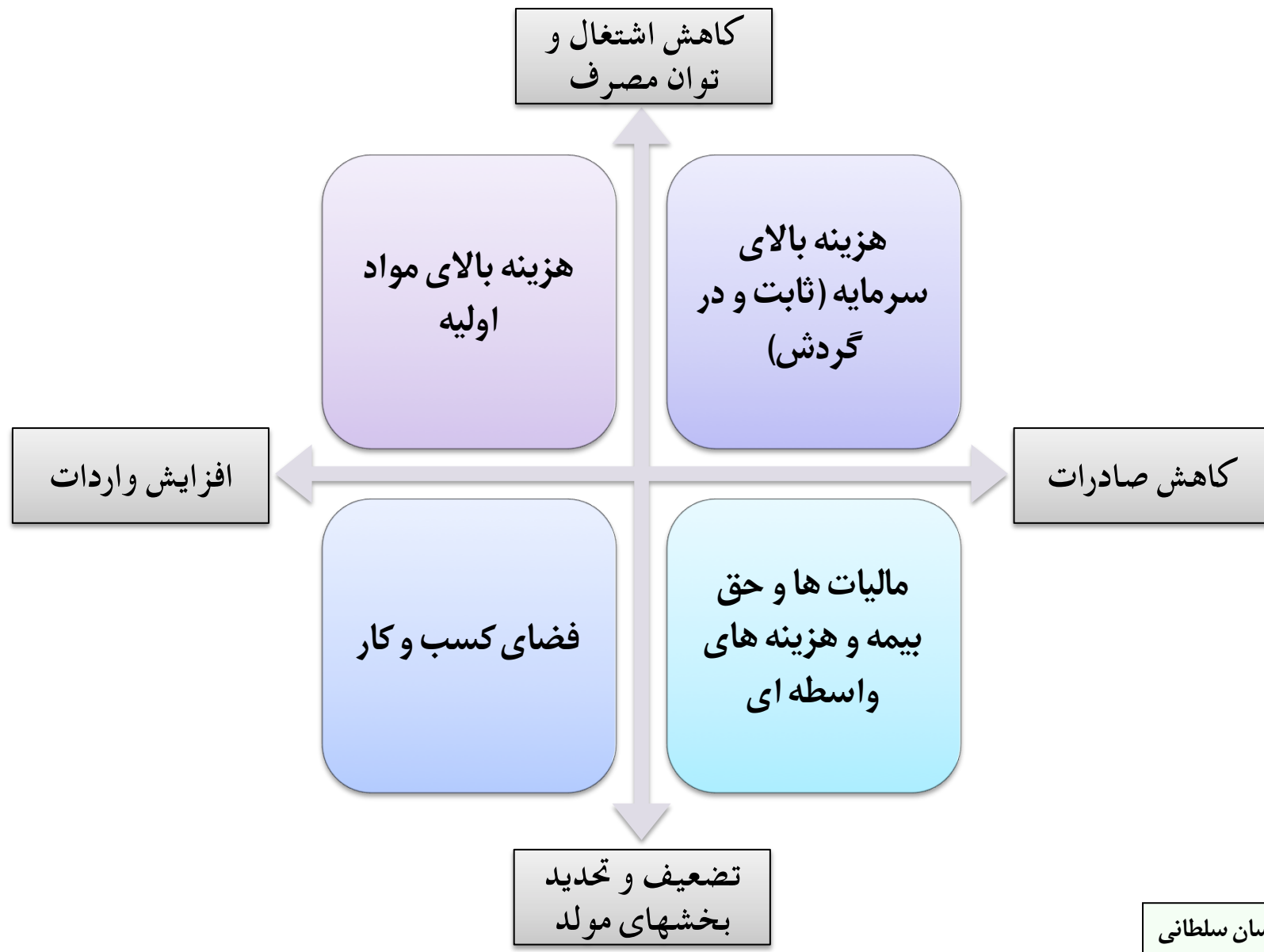
کارکرد افزایش نرخ ارز در توسعه اقتصادی مبتنی بر افزایش صادرات



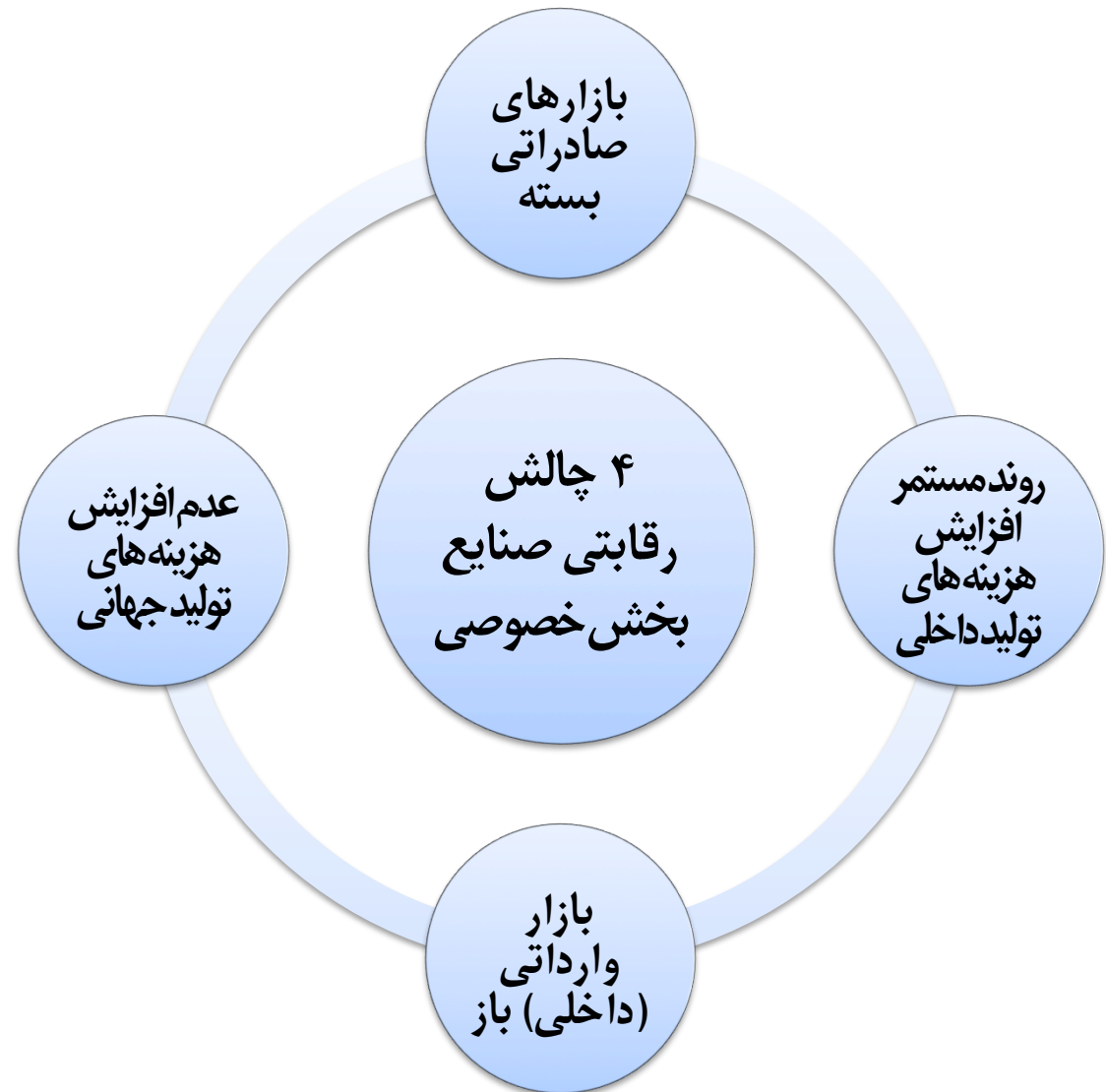
کارکرد افزایش نرخ ارز در اقتصاد رانتی ایران



ساز و کار اقتصادی ضد بخش خصوصی مولد



۴ چالش رقابتی نابودکننده صنایع بخش خصوصی



تروئیکای اقتصاد ضد تولید

جان مینارد کینز می گوید: "رکودهای عمیق معمولاً هنگامی سر بر می آورند که پول از چرخه صنعتی خارج شود و به چرخه مالی سوق داده شود." توماس پیکتی نیز بر آن تاکید دارد: "شایسته سالاری زمانی از بین می رود که نرخ بازدهی پول و سرمایه از نرخ بازدهی فعالیت های مولد سبقت بگیرد"

رباخواری
(بانکها)

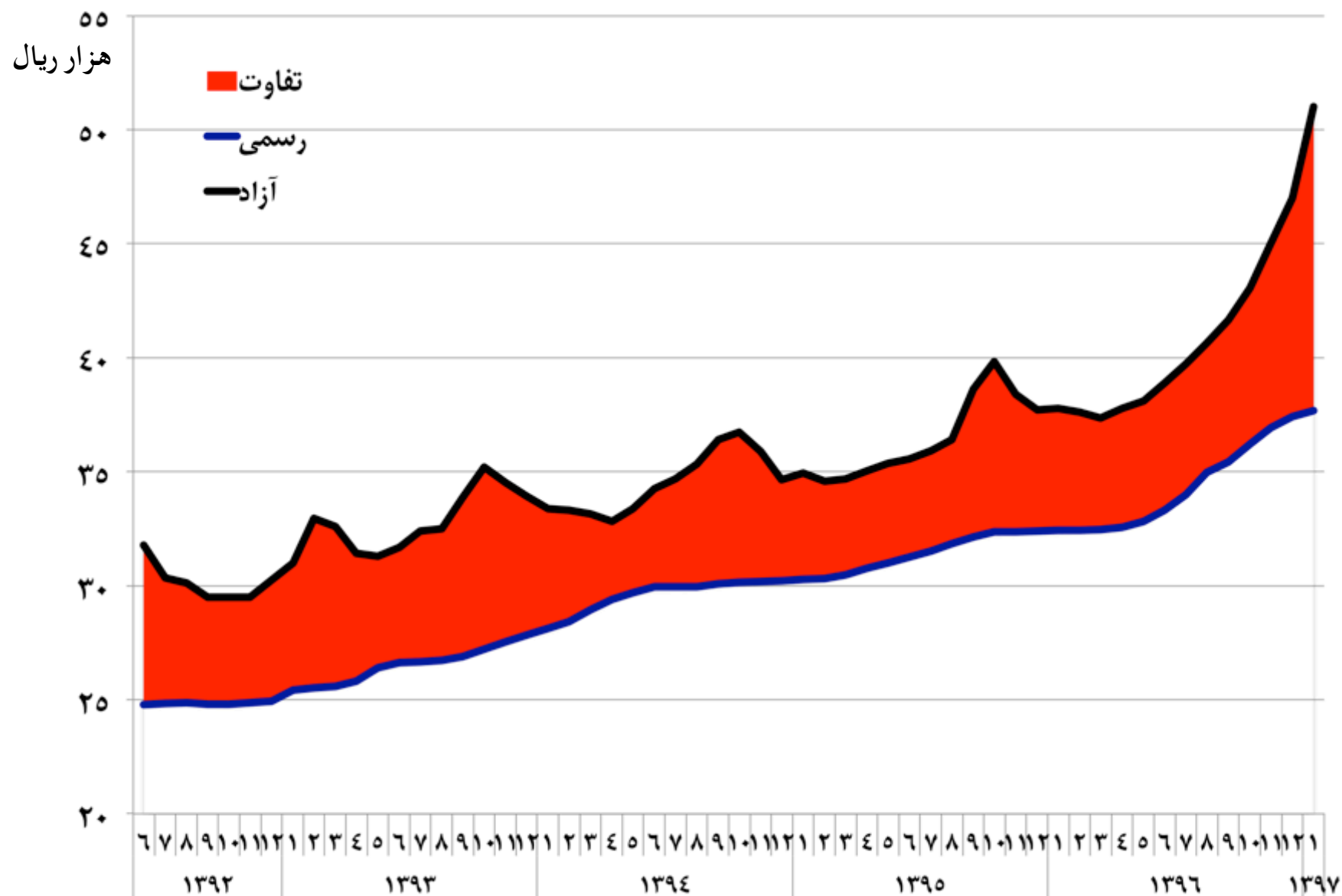


سفته بازی



سوداگری و دلالی

سفته بازی و رانت در افزایش نرخ ارز

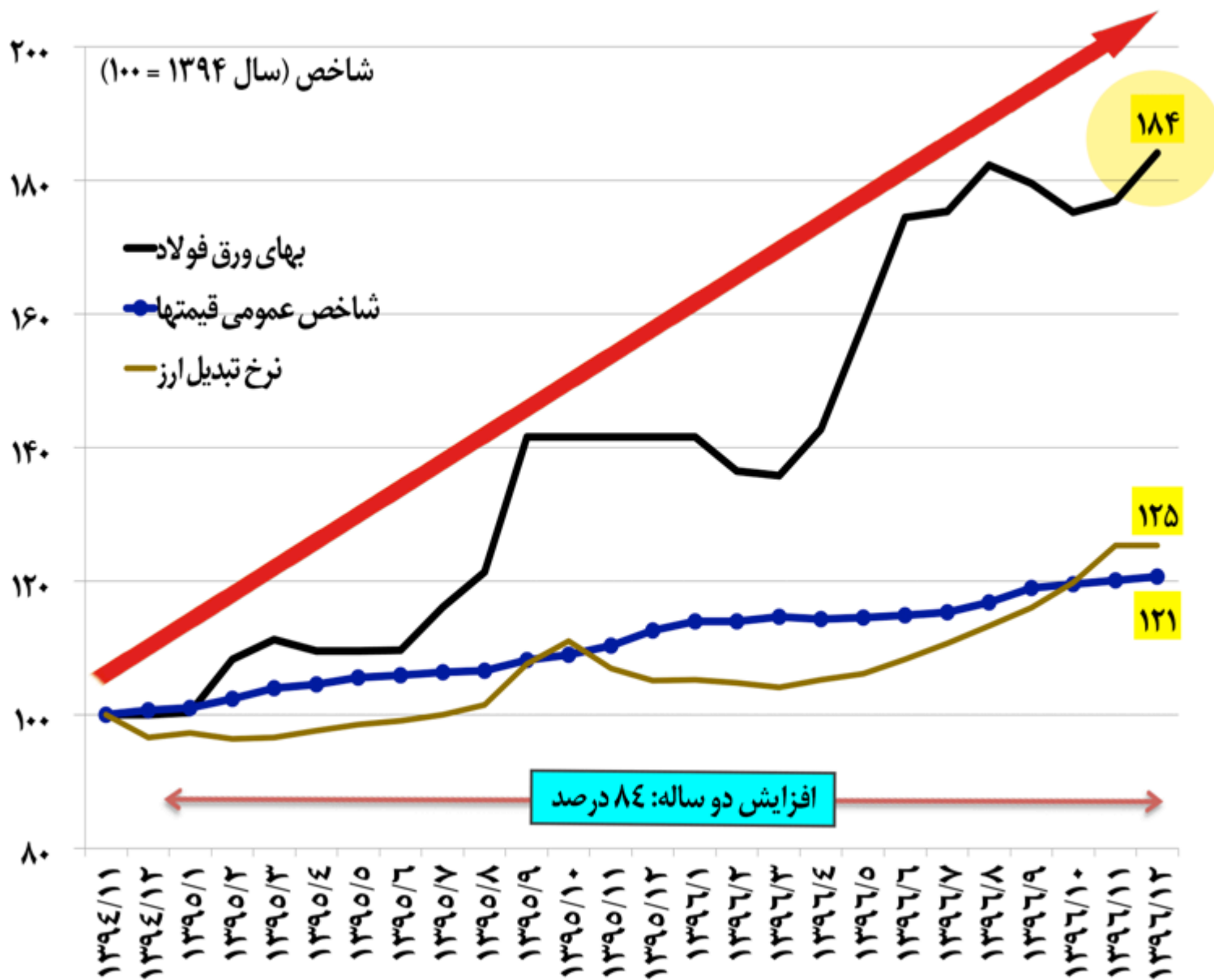


صنایع فلزی کشور

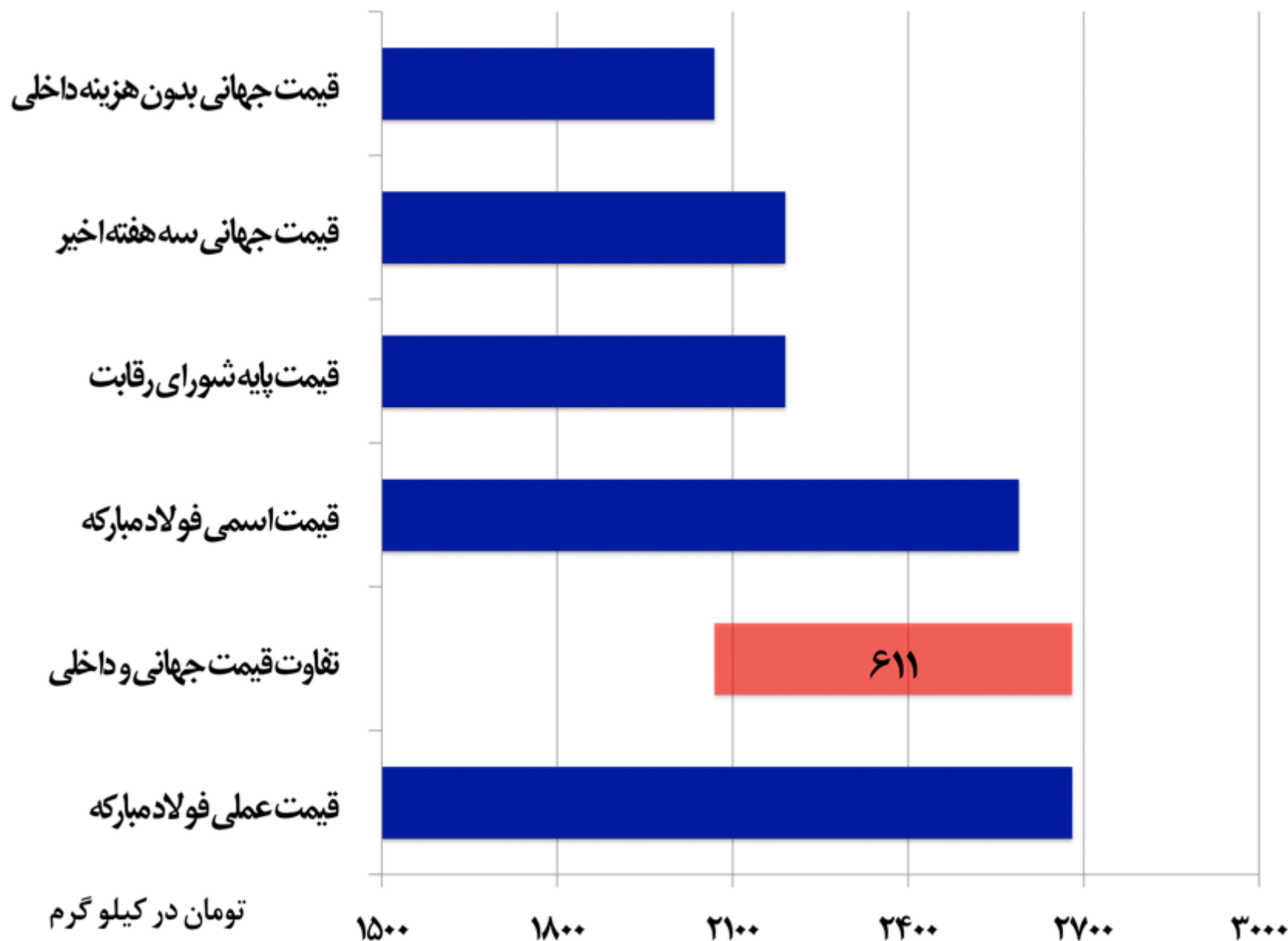
بر اساس داده های طرح آمارگیری مرکز آمار ایران در سال ۱۳۹۰، ۴۰۰ هزار نفر در صنایع فلزی کشور اشتغال داشتند که با احتساب دیگر صنایع مرتبط با فولاد مانند ماشین آلات مکانیکی، ماشین سازی و خودرو، مجموع اشتغال زنجیره پایین دستی فولاد به بیش از ۷۰۰ هزار نفر بالغ می گردد. در همین حال کل اشتغال واحدهای بزرگ بالادستی آهن و فولاد کمتر از ۵۰ هزار نفر است.

رویکرد دولت با صنایع مهم و کلیدی فولاد در چند سال اخیر مثالی بارز و آشکار از چگونگی نگرش و برخورد دولت با صنایع پایین دستی و ایجاد اشتغال مولد است. ارزان فروشی صادراتی و گران فروشی داخلی که به انحاء مختلف توسط دولت حمایت می شود در چند سال اخیر تشدید شده است. افزایش قیمت ارز در عمل موجب می شود که با افزایش بیشتر بهای فروش داخلی، نظر به نبود توان مصرف متناسب با افزایش قیمت، در نتیجه کاهش مصرف داخلی، رکود در صنایع پایین دستی تشدید گردد. رفتار تبعیض آمیز، نامتناسب، نامتوازن و ناعادلانه بین صنایع بالادستی خصولتی و پایین دستی بخش خصوصی واقعی، نشان می دهد که هدف دولت در اصل تامین منافع بنگاه های رانتی- خصولتی است.

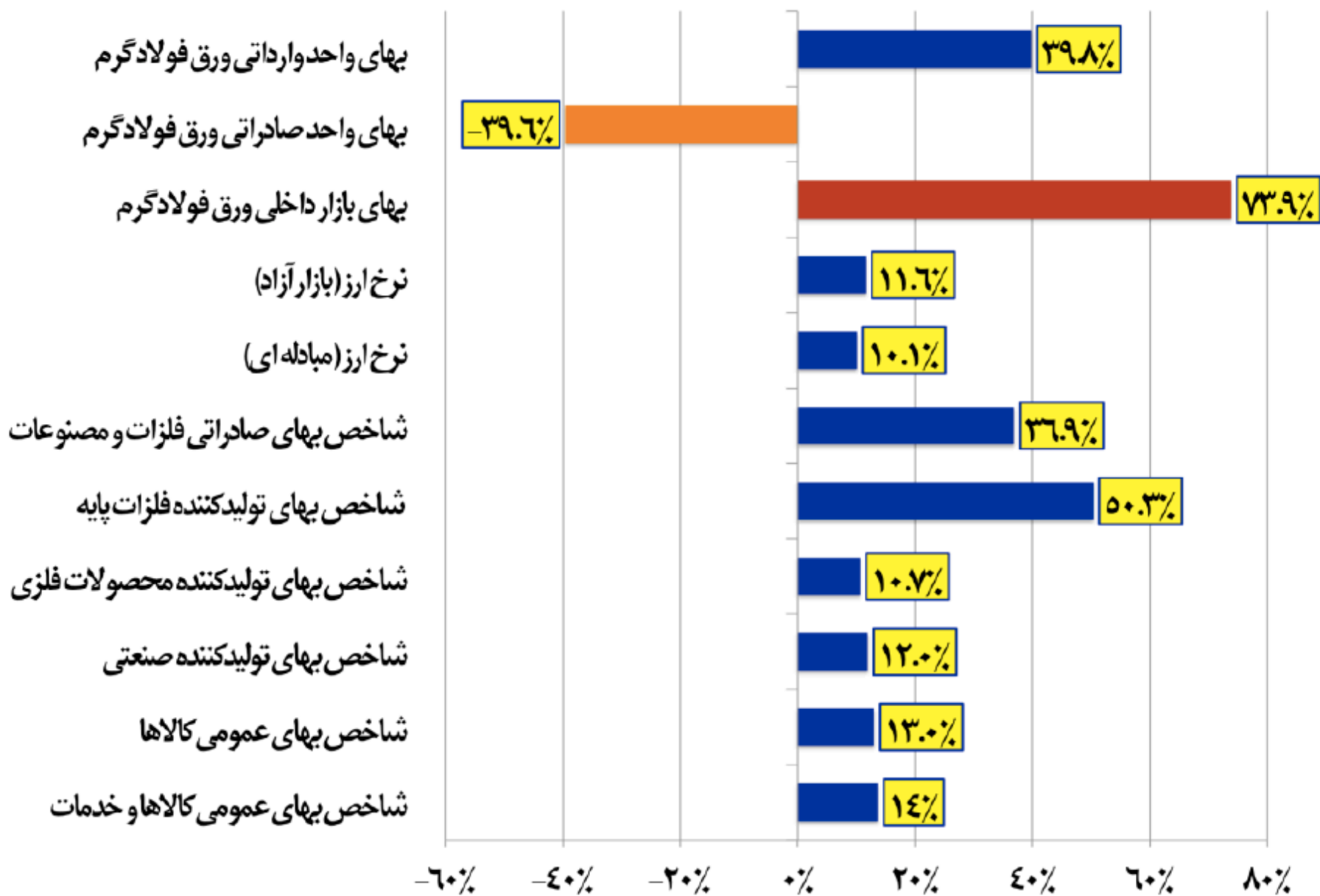
شاخص میانگین بهای ماهانه ورق فولاد گرم در بورس کالا



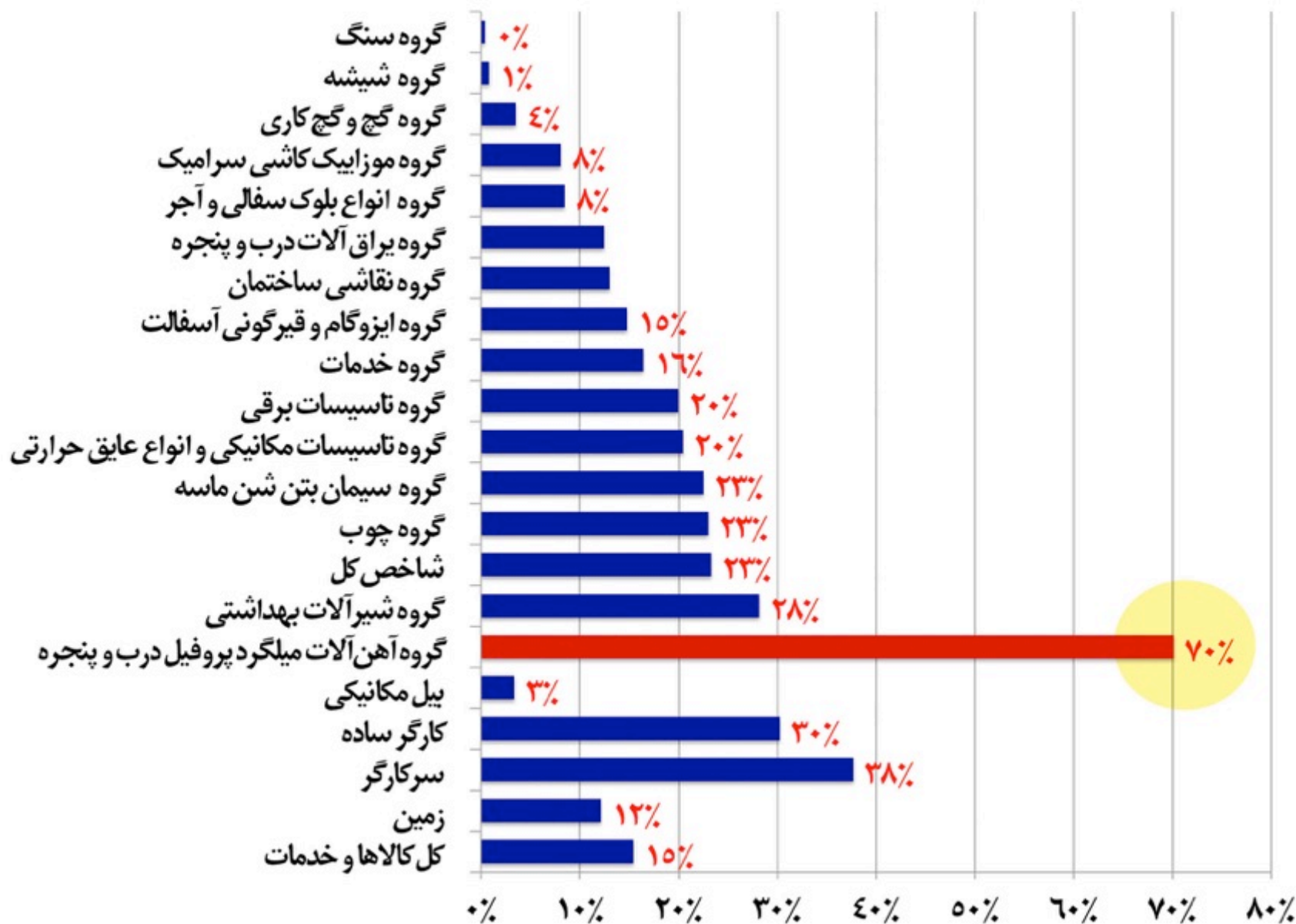
میانگین بهای ماهانه ورق فولاد گرم در بورس کالا (آبان ۱۳۹۶)



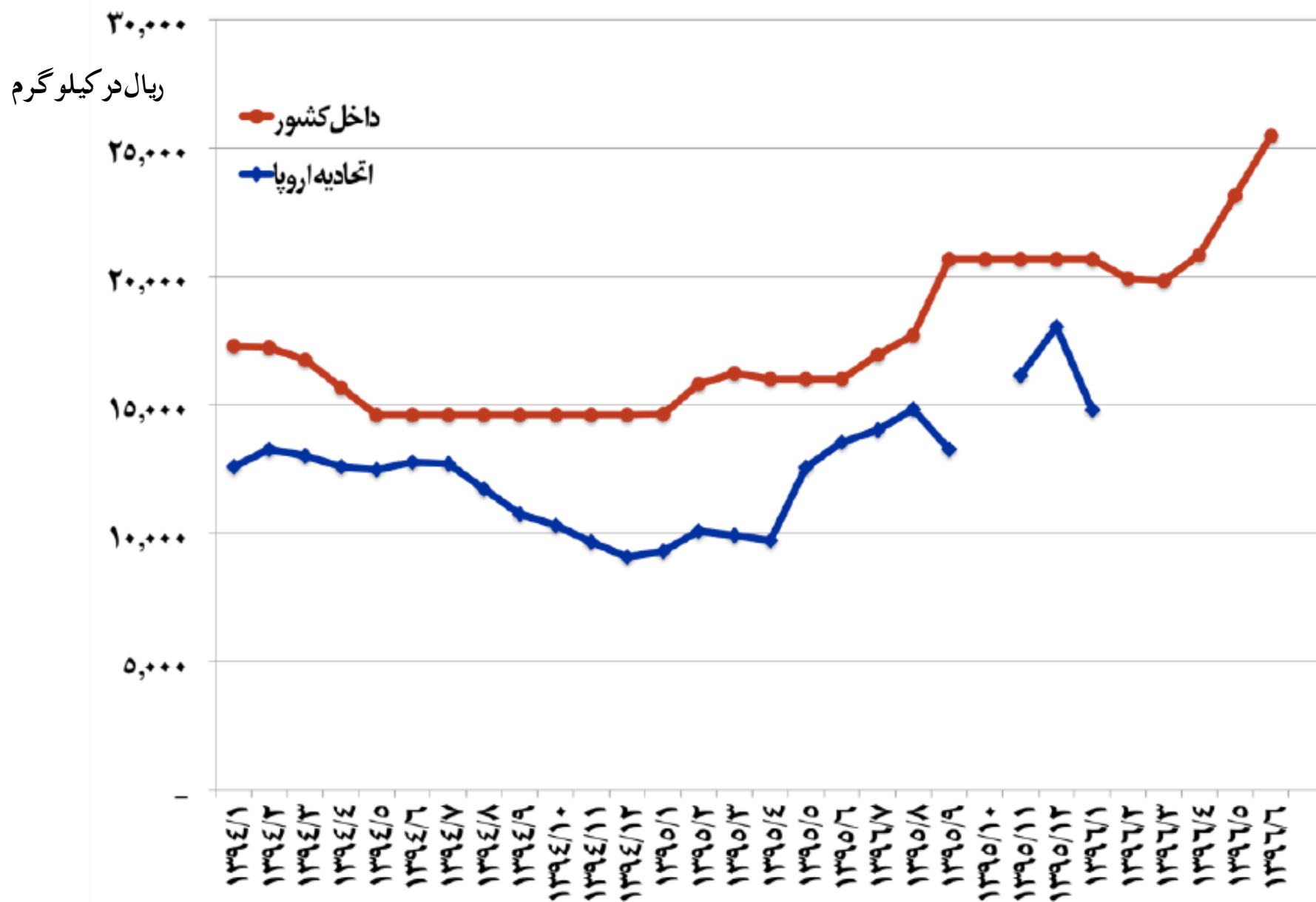
افزایش بهای ورق فولاد گرم و شاخص های قیمت در دوره فروردین ۱۳۹۵ تا شهریور ۱۳۹۶



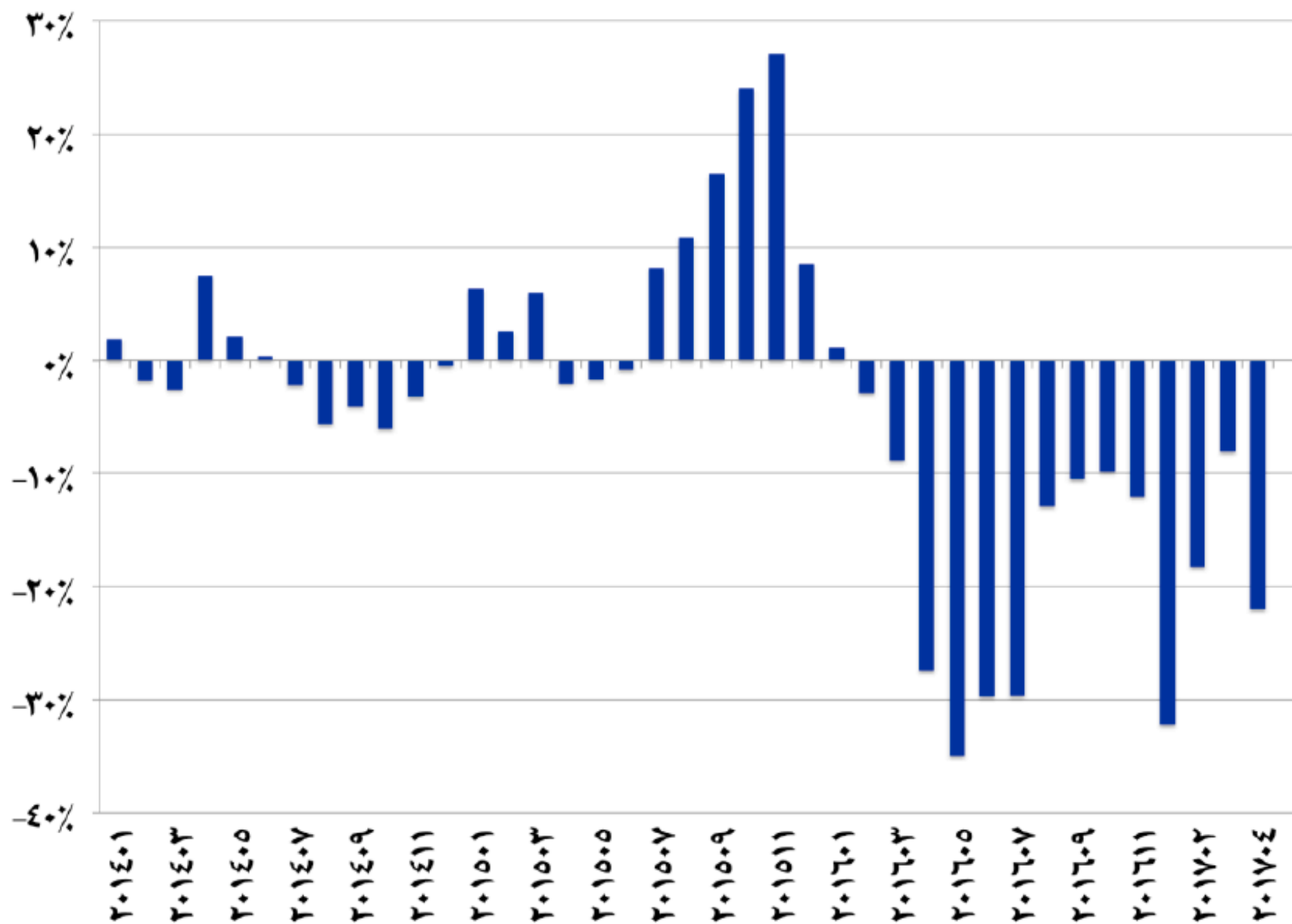
افزایش بهای نهاده های تولید ساختمان در سال ۱۳۹۶ نسبت به ۱۳۹۴



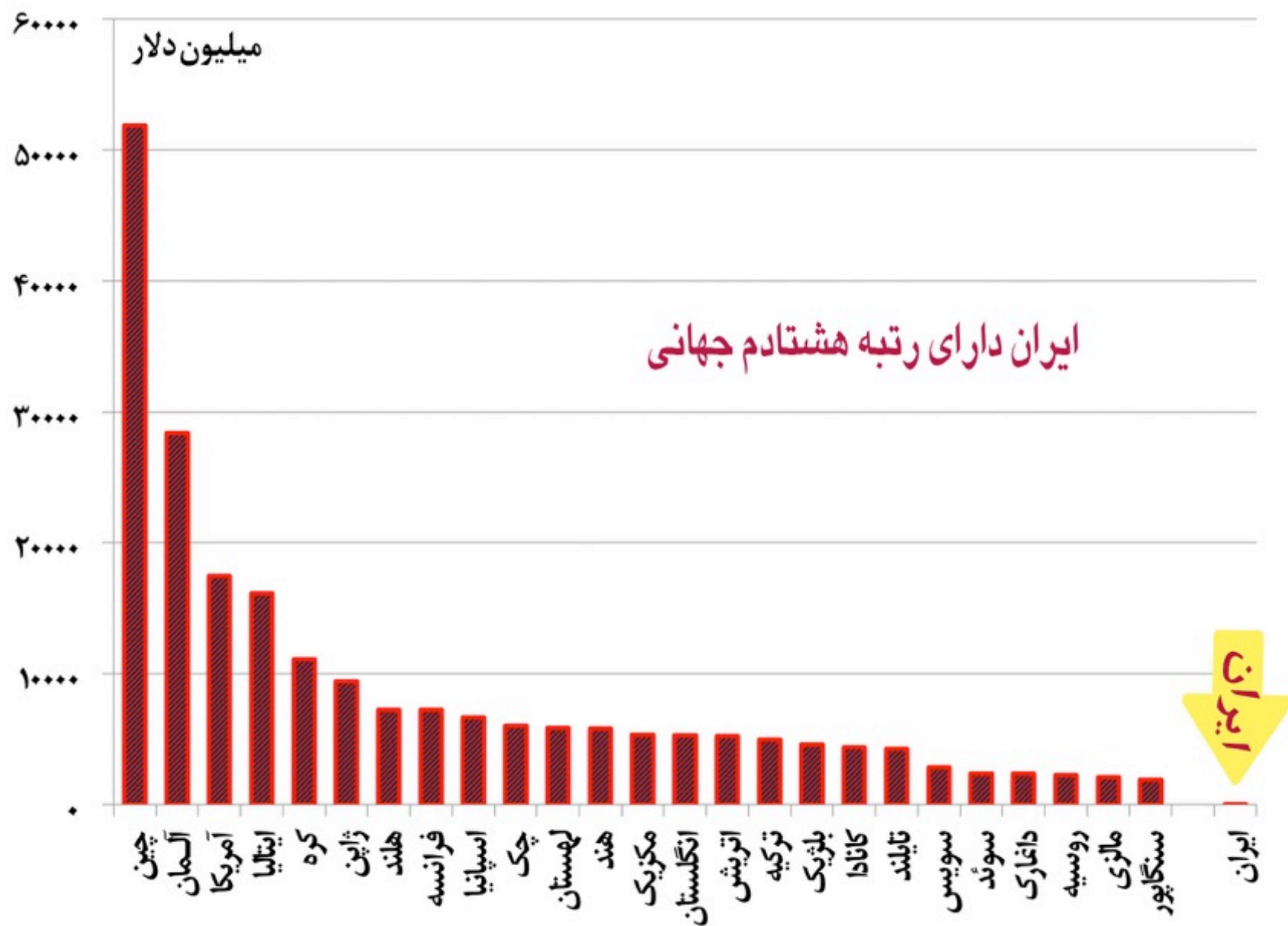
بهای فروش داخلی ورق فولاد گرم در مقایسه با بهای صادراتی به اتحادیه اروپا



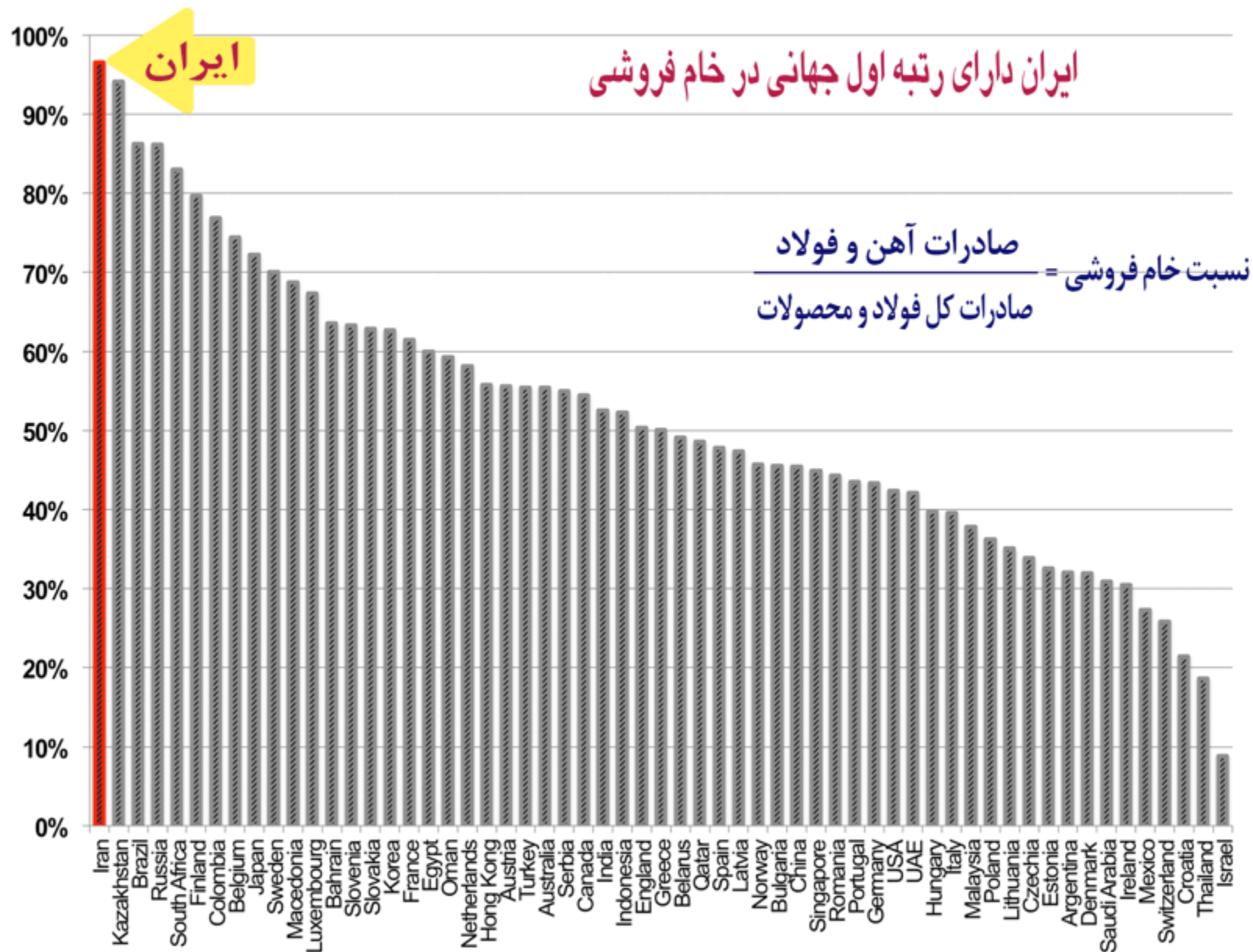
نسبت بهای صادراتی ورق گرم فولاد ایران به اتحادیه اروپا به بهای تحویل بنادر جنوب اروپا



صادرات محصولات فولادی ایران و ۲۵ صادرکننده بزرگ



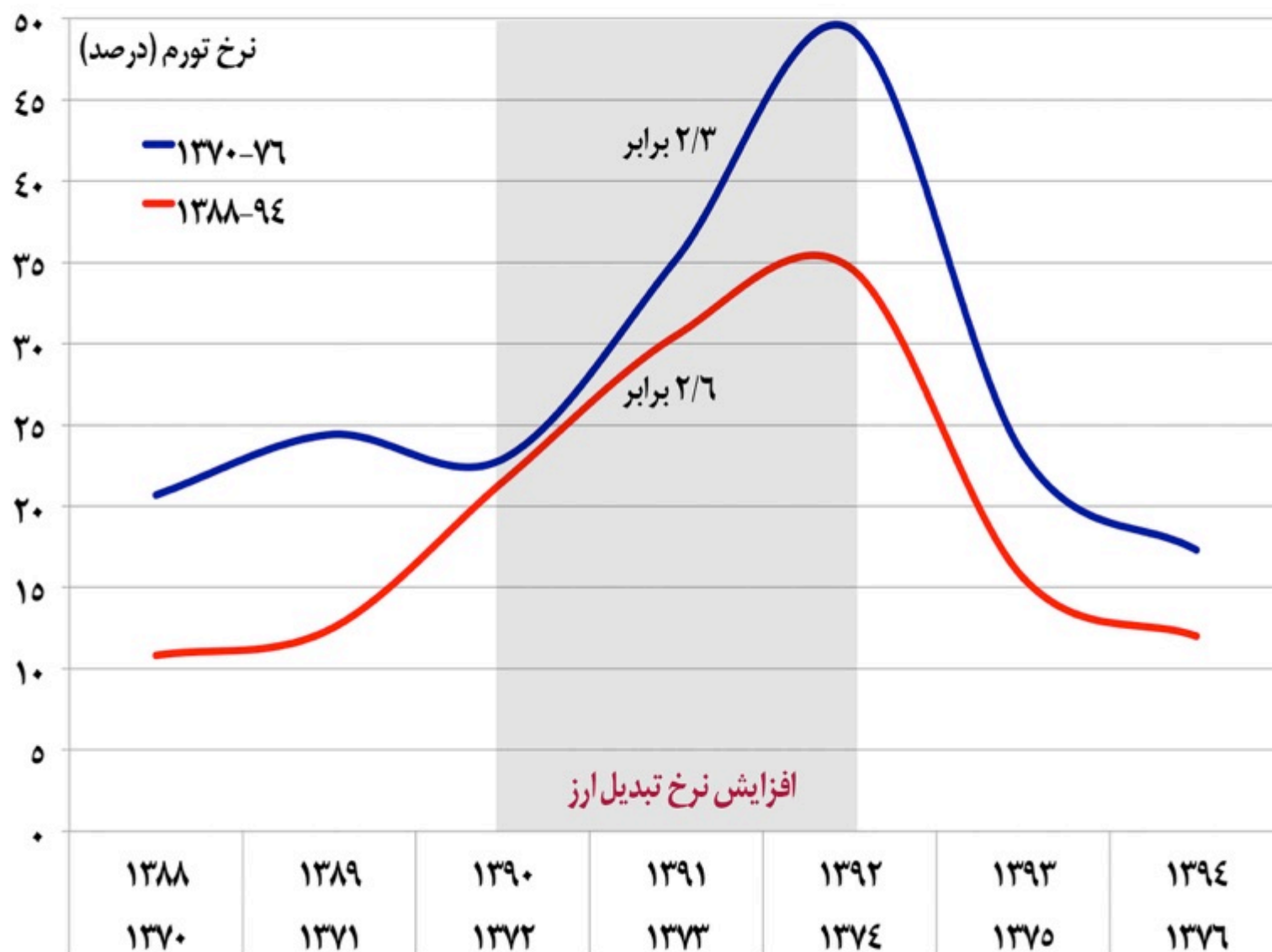
نسبت خام فروشی در زنجیره فولاد



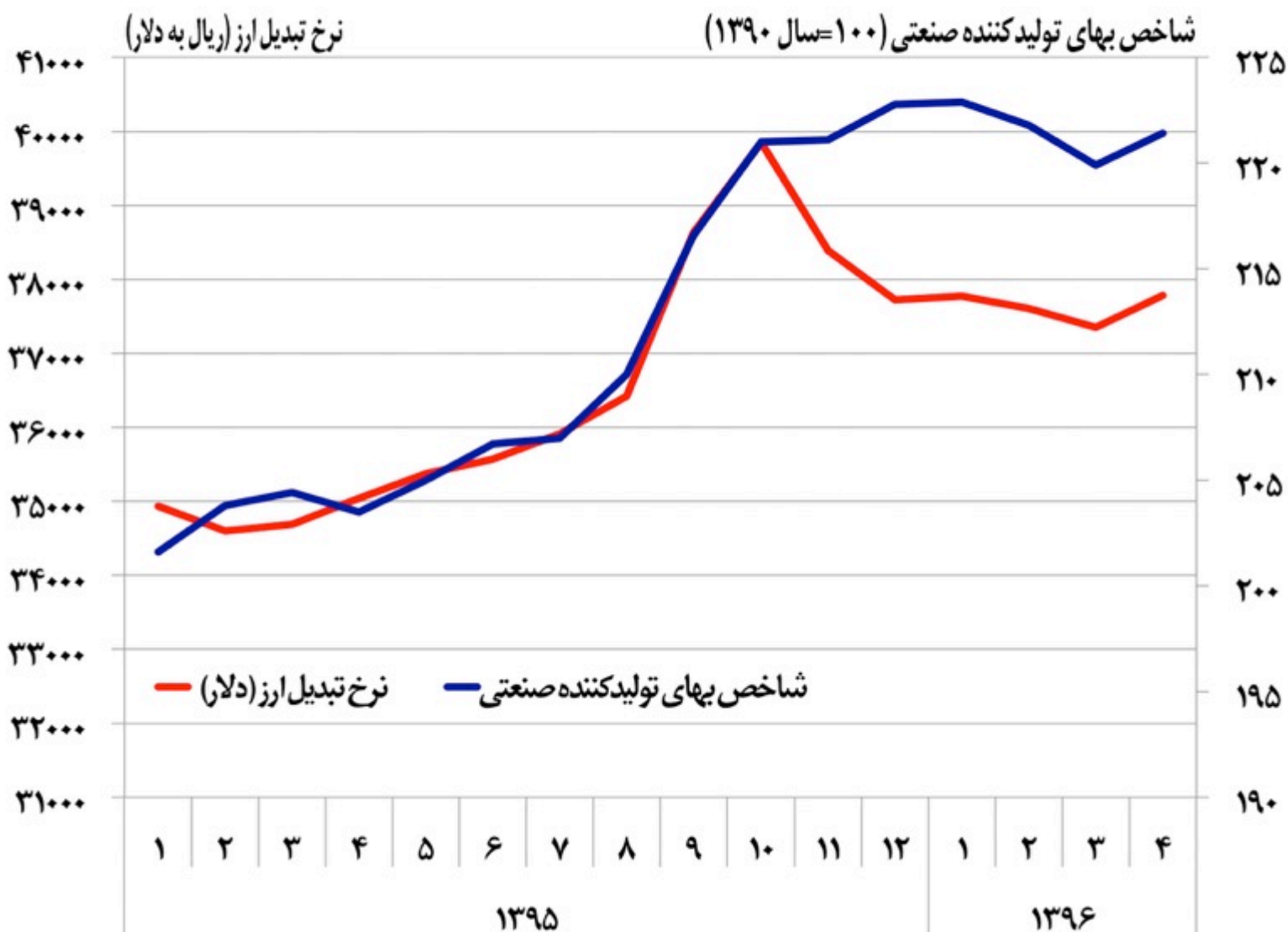
چالش ها و تهدیدها



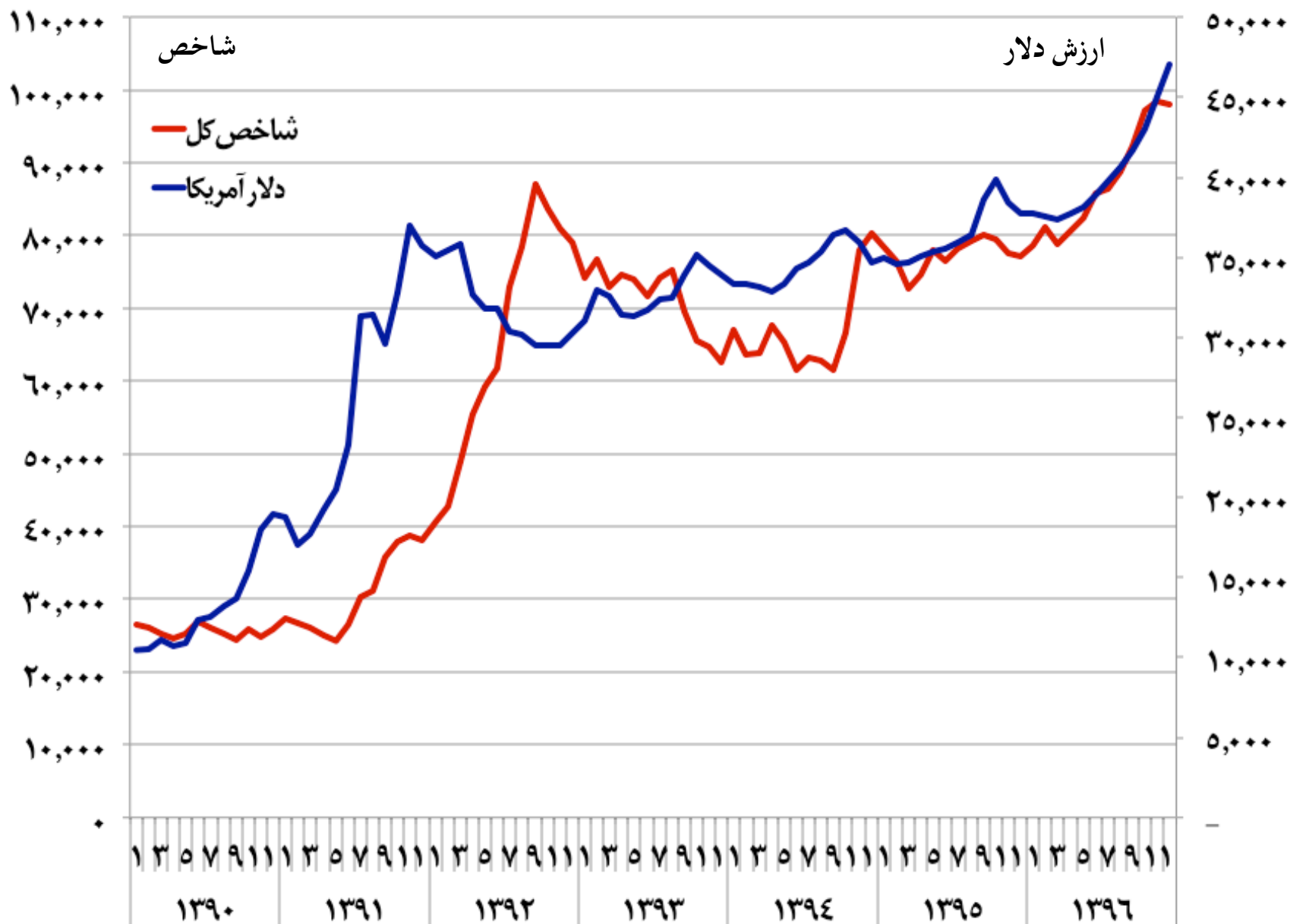
روند رشد نرخ تورم در دو دوره افزایش شدید نرخ تبدیل ارز



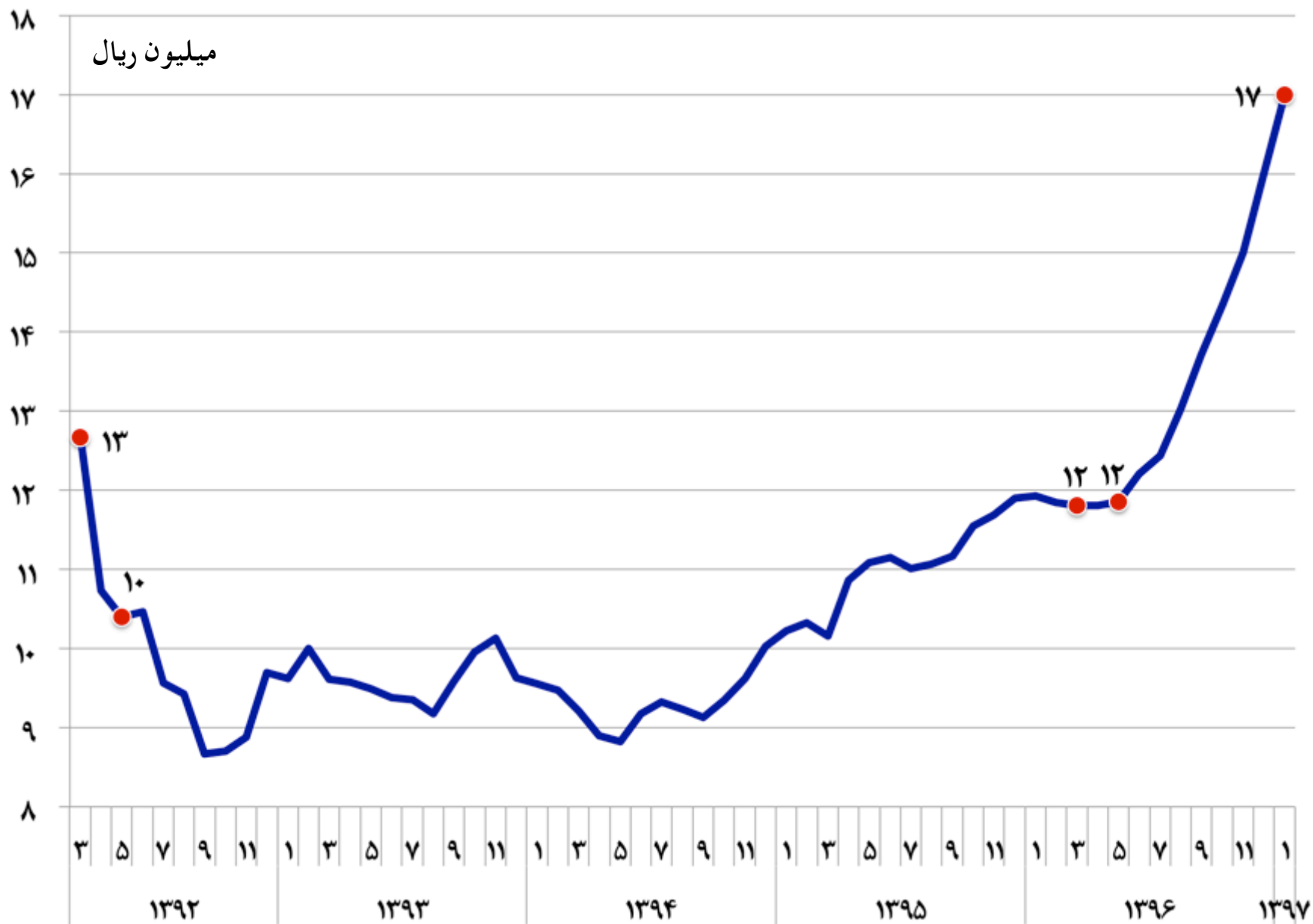
روند رشد بهای تولیدکننده صنعتی و نرخ تبدیل ارز (فروردین ۱۳۹۵ تا تیر ۱۳۹۶)



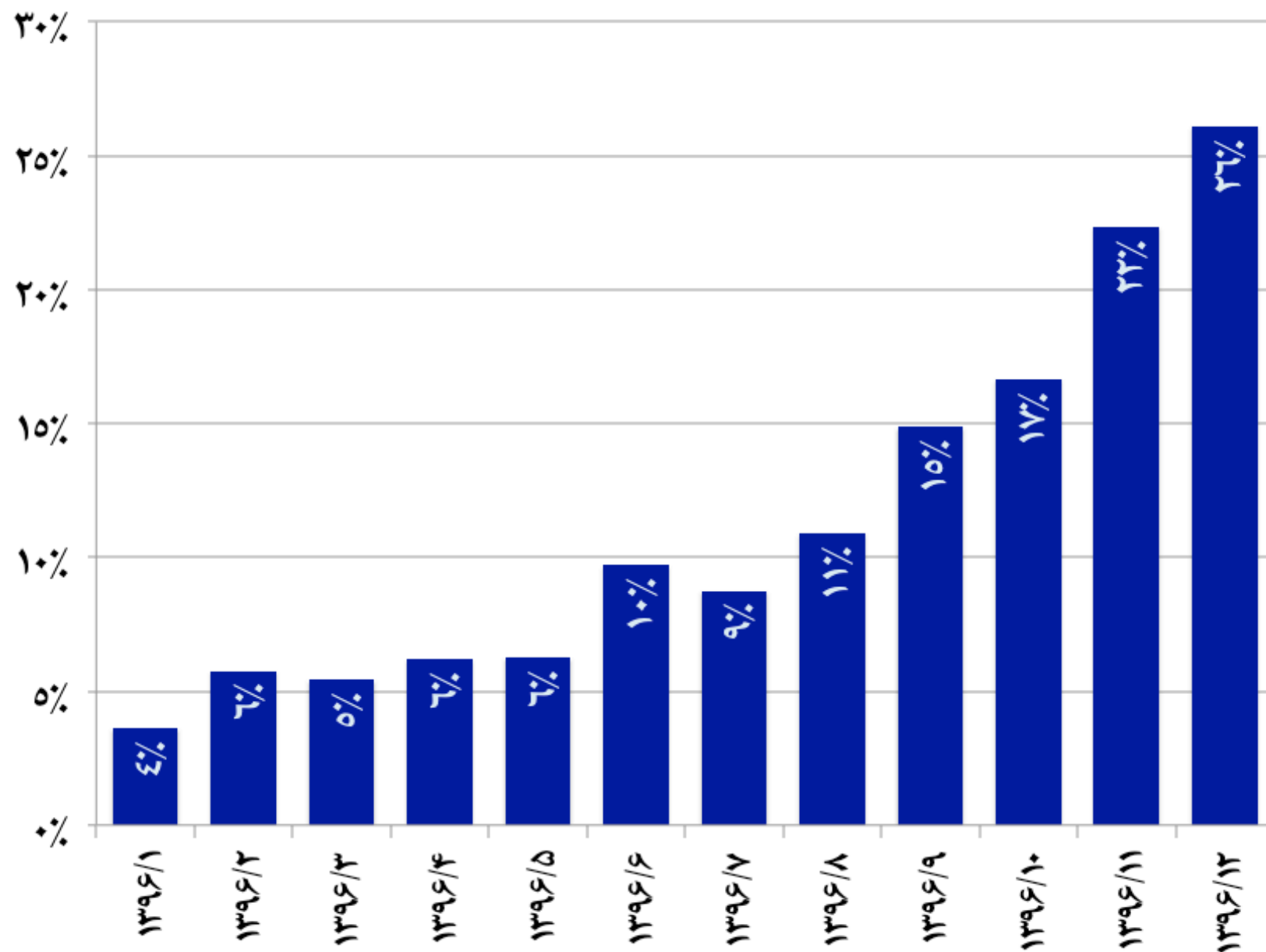
رشد ارزش اسمی بازار سرمایه همراه با افزایش نرخ ارز



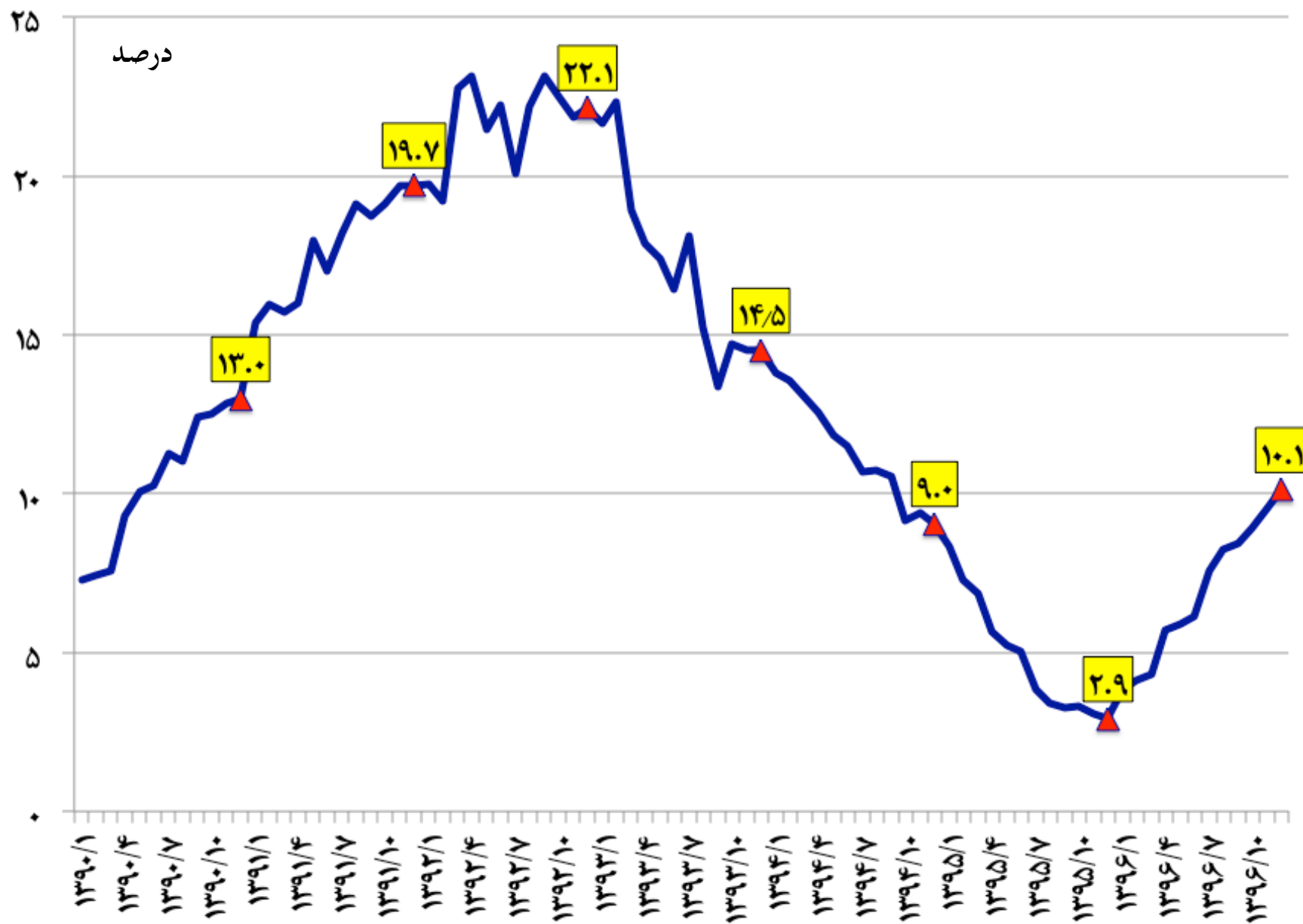
بهای سکه طلا در بازار تهران



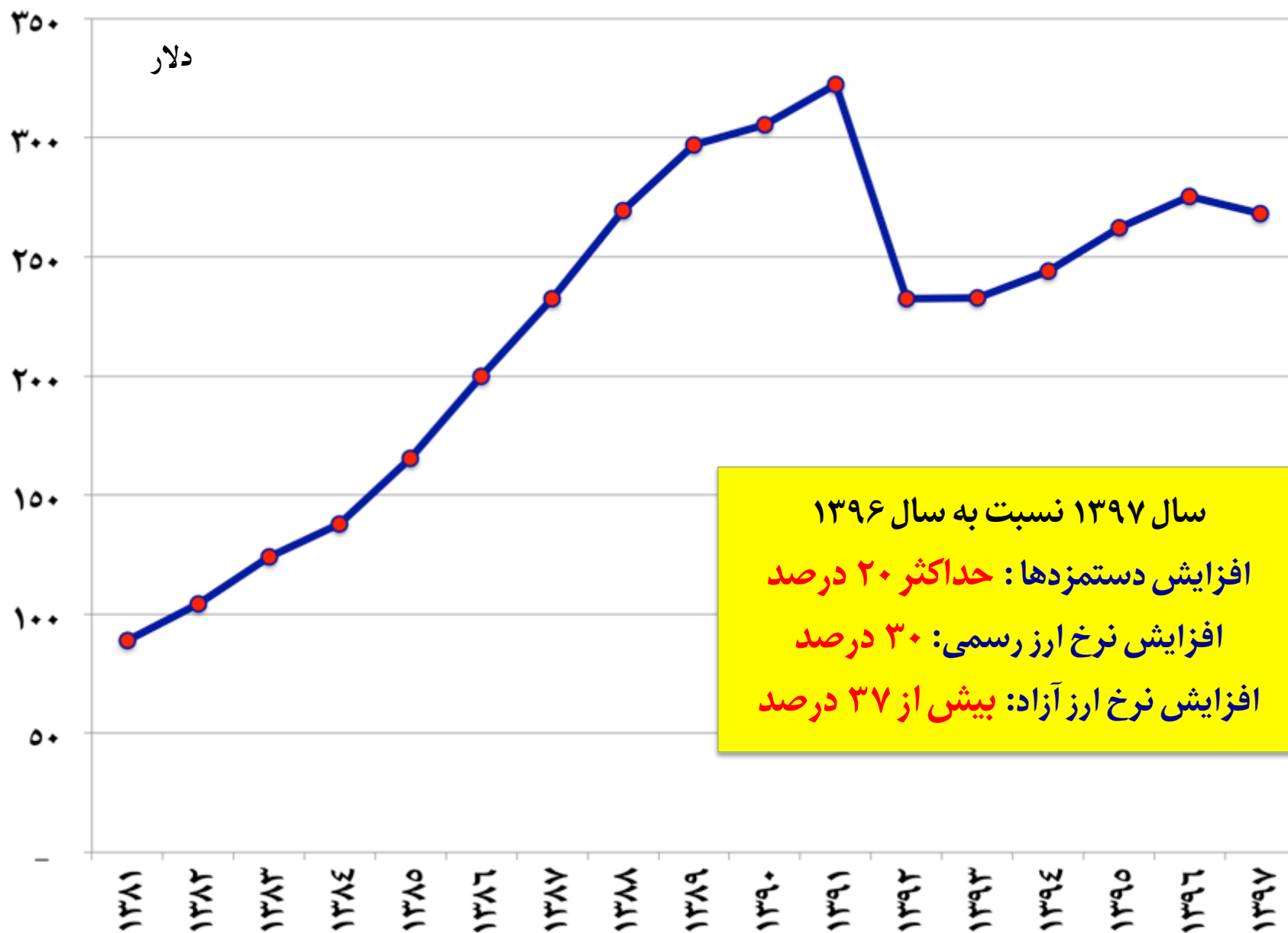
نرخ رشد ماهانه میانگین قیمت آپارتمان های معامله شده در شهر تهران در سال ۱۳۹۶ نسبت به ۱۳۹۵



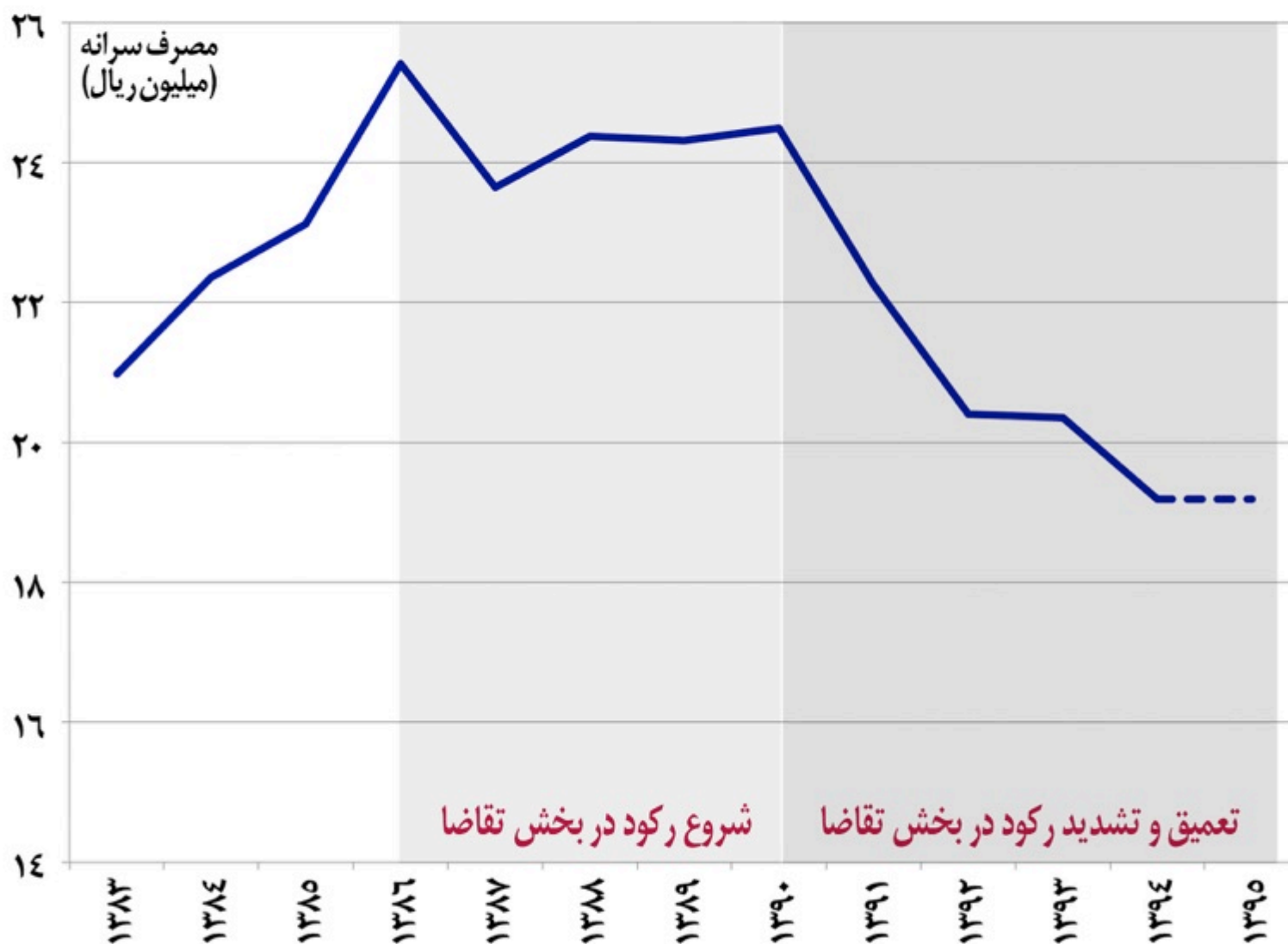
نرخ تورم اجاره مسکن خانوارهای شهری



حداقل دستمزد ماهانه

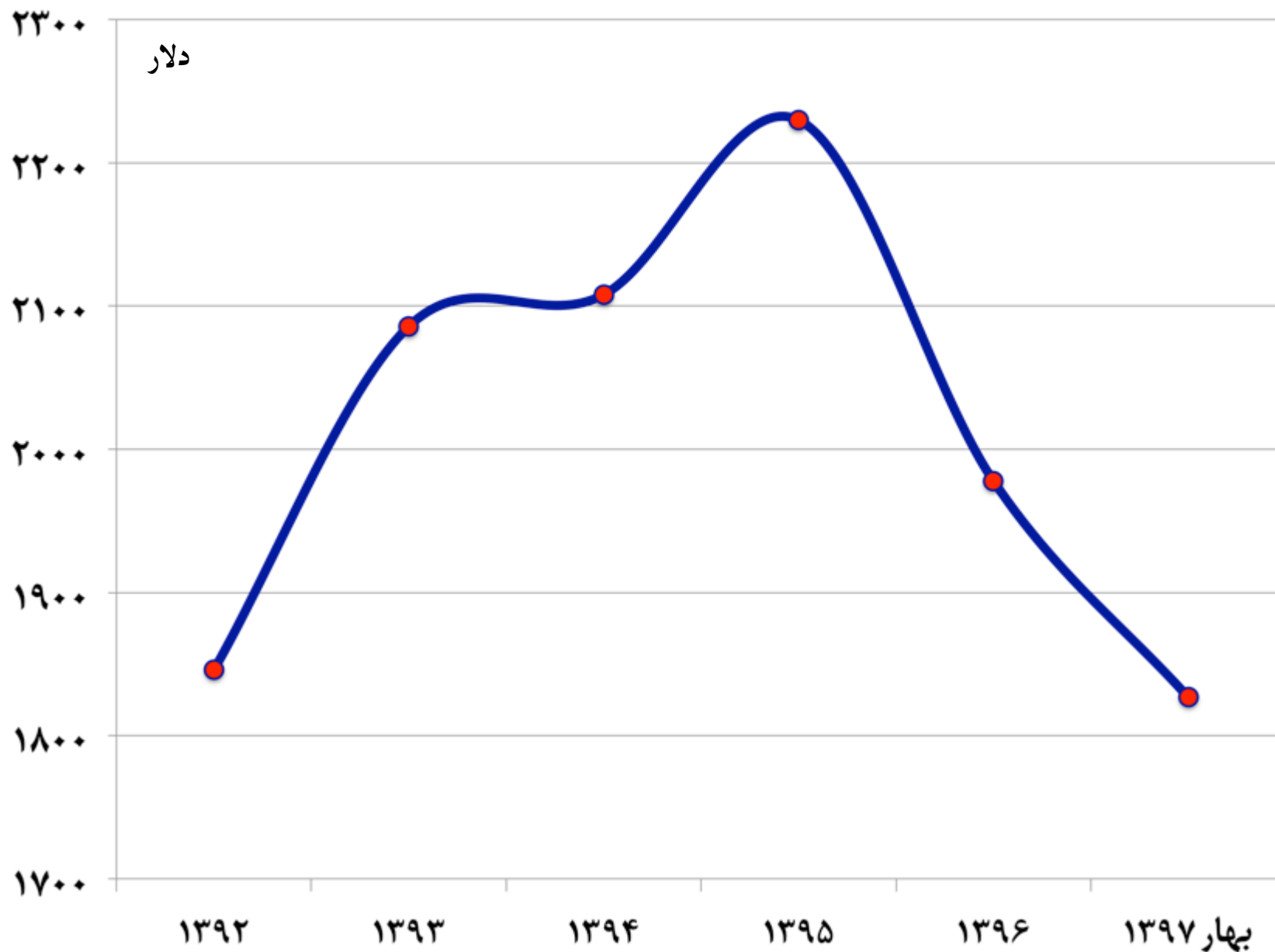


روند خلق و تشدید رکود در سطح مصرف خانوارها

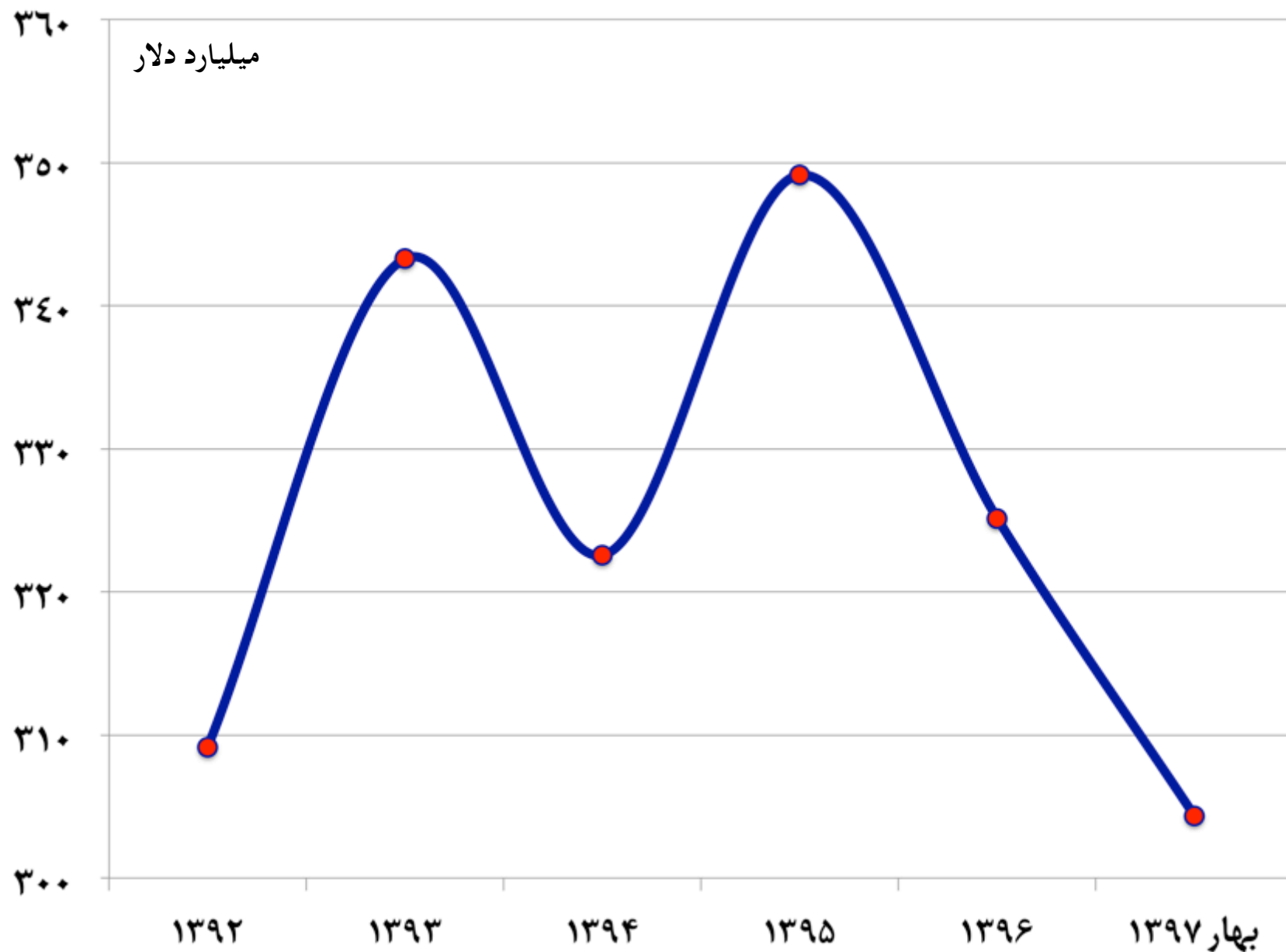


تحلیل و استنتاج: احسان سلطانی بر اساس داده های بانک مرکزی ایران

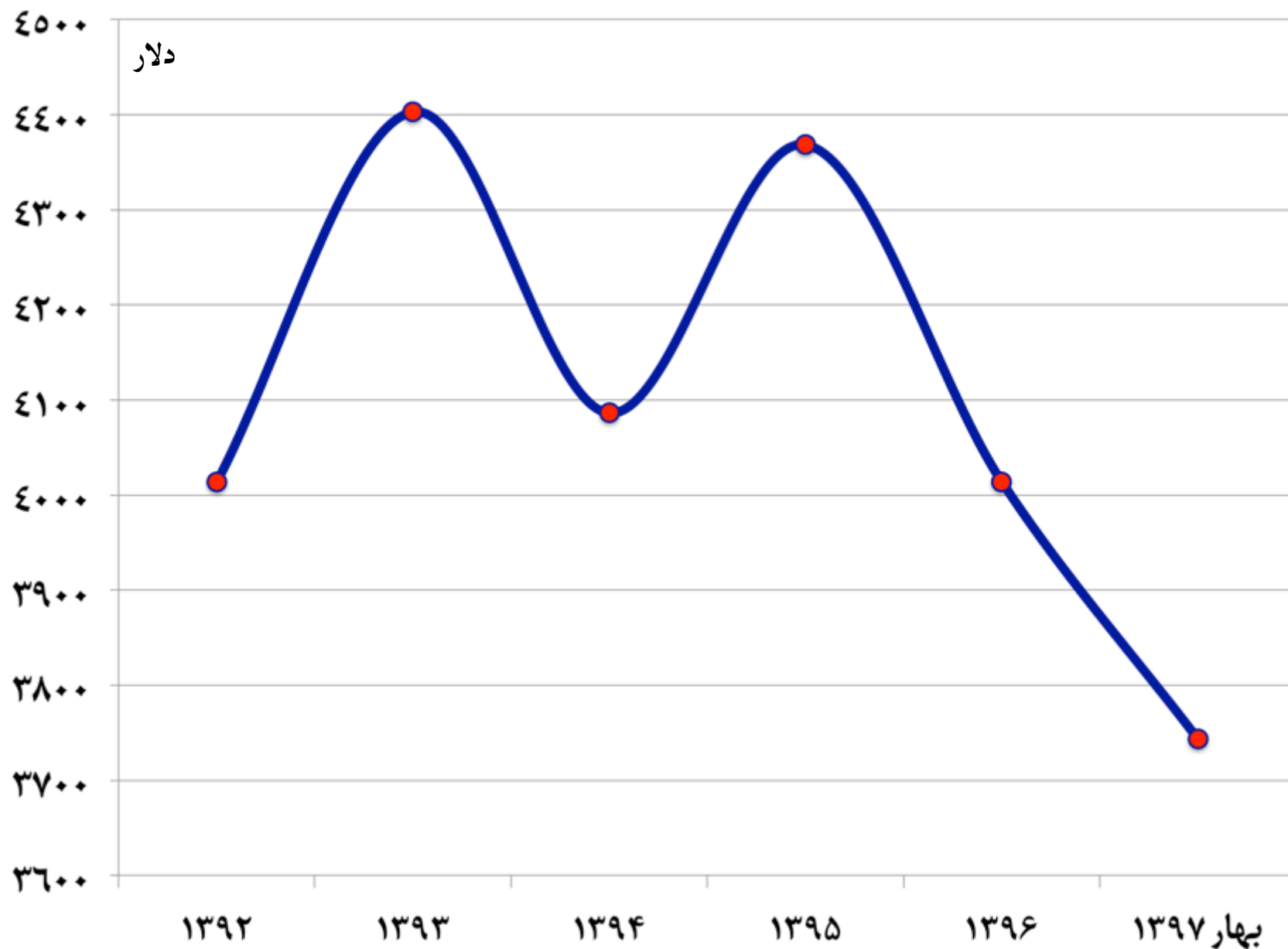
سرانه مخارج مصارف نهایی خانوار ایران



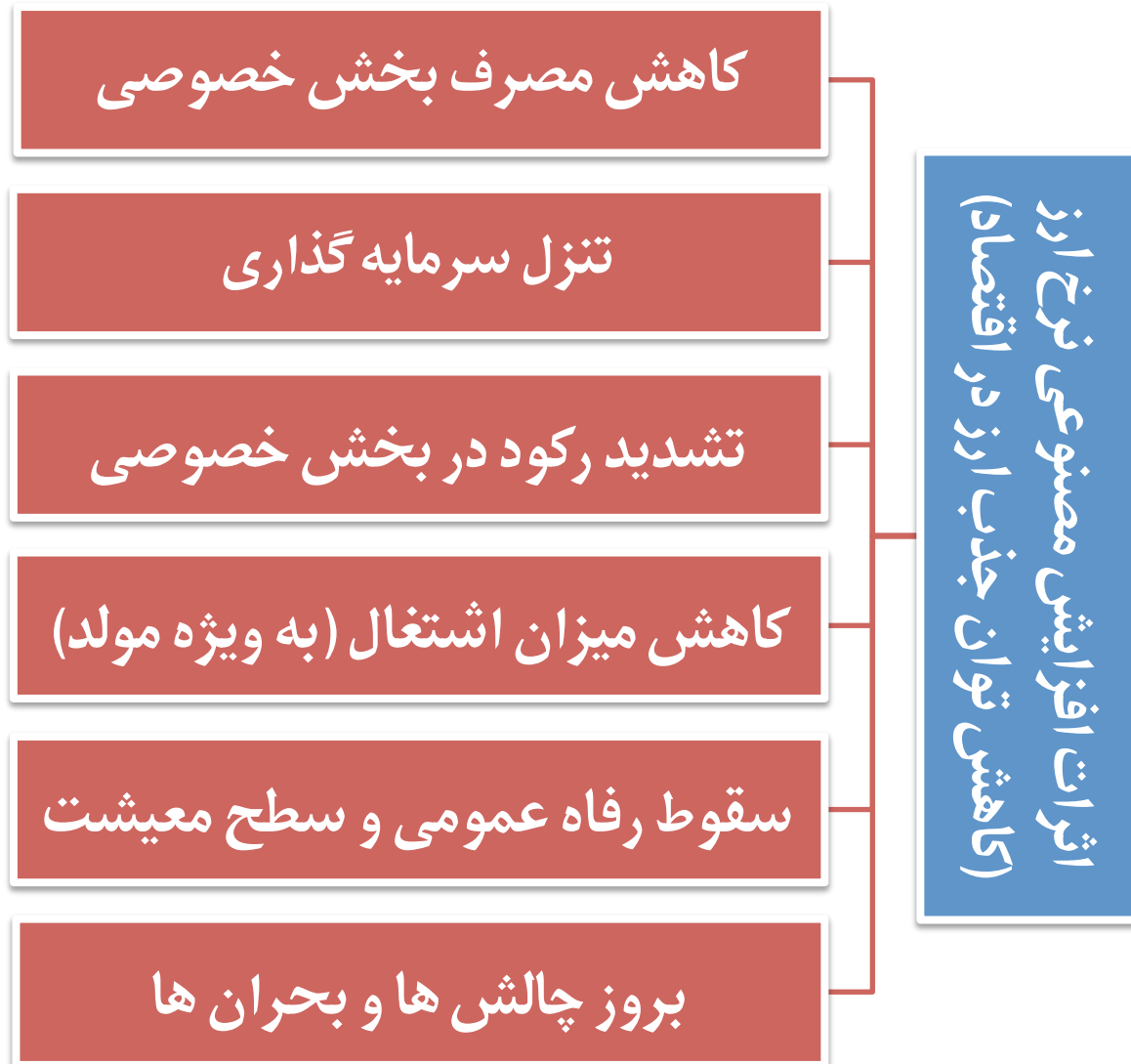
ارزش ارزی تولید ناخالص داخلی ایران



ارزش ارزی سرانه تولید ناخالص داخلی ایران

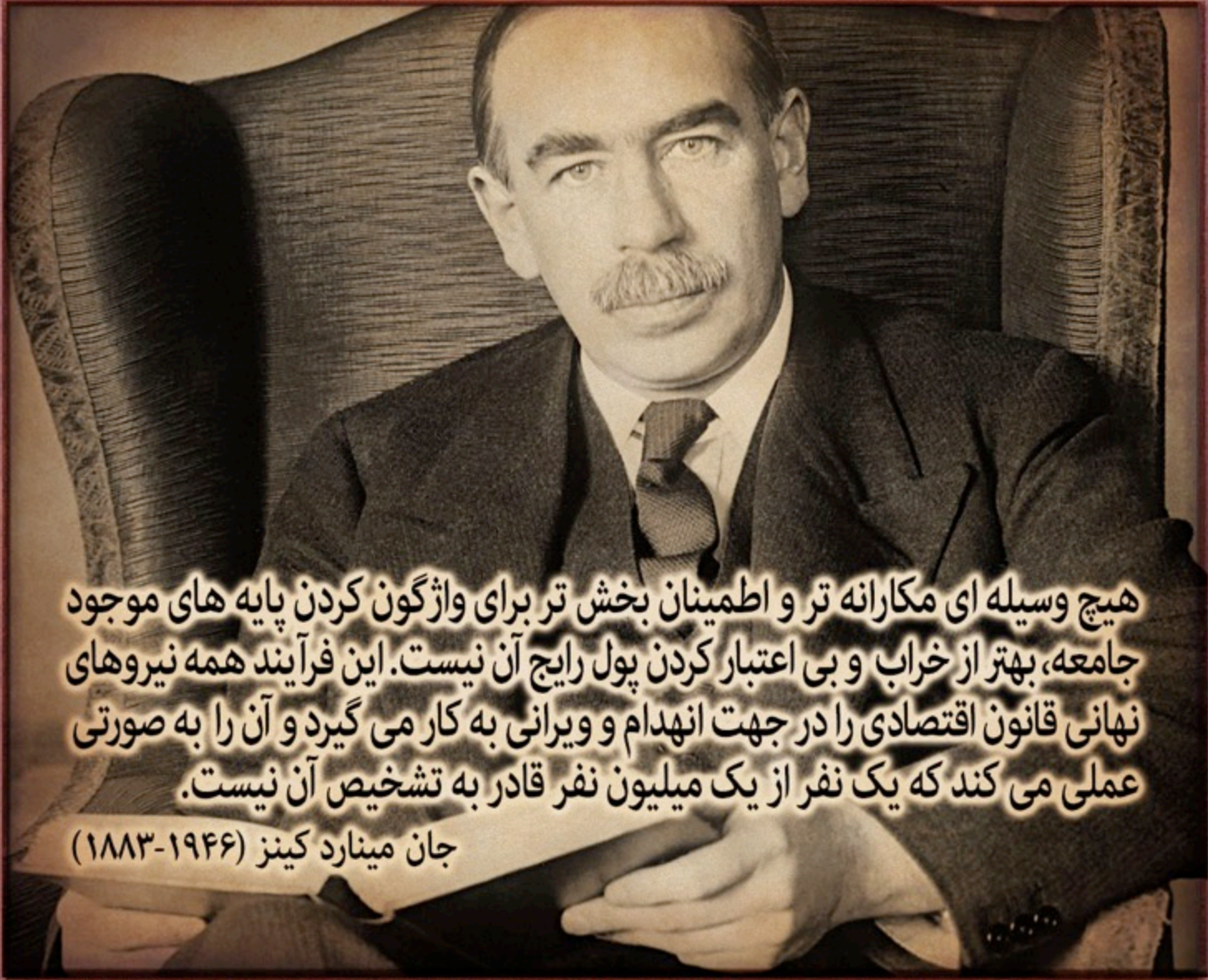


اثرات افزایش مصنوعی نرخ ارز



مالیات تورمی

در اقتصاد تک محصولی ایران، تنها راه حل مرسوم و سهل الوصول جهت رفع کسری بودجه و تنگناهای مالی نرخ ارز است و با نادیده گرفتن ریشه ها و عوامل کلیدی، نسخه افزایش نرخ ارز و اقلام اساسی به عنوان تنها راهکار کلیدی اقتصاد معرفی می شود. این نسخه برای گذران روزمره امور دولت و استمرار کسب منافع رانتهی ها، همه فشارها را با اعمال مالیات تورمی به عامه مردم منتقل می کند. در این میان به سود بنگاه های دولتی و شبه دولتی و قشر قلیلی از جامعه، بخش خصوصی واقعی و مردم روز به روز نحیف تر و ضعیف تر می شوند. سیاستگذاری ها به جای کاهش نرخ تورم و پرداختن به ریشه مشکل به درمانی معطوف می شود که اقتصاد را وارد مارپیچ تورمی و دور تسلسل مخرب «افزایش نرخ ارز» افزایش نرخ تورم» افزایش نرخ ارز» می کند. این موضوع یعنی مالیات تورمی که در اصل فشار آن به اقشار ضعیف و متوسط وارد می شود. در سناریوی اعمال مالیات تورمی به جای «قطع مخارج غیر حاکمیتی و غیر ضروری دولت»، «قطع و یا حداقل توزیع و کاهش تدریجی رانتهای» و «اخذ مالیات از ثروتمندان و درآمدهای بالا»، با ایجاد تورم (از طریق بالا بردن بهای اقلام کلیدی، خدمات دولتی و نرخ ارز) فشار همه اینها به عامه مردم منتقل می گردد که پیامدهای آن افزایش فقر و نابرابری، تشدید رکود در بخش خصوصی و بیکاری است.

A black and white portrait of a middle-aged man with a mustache, wearing a dark suit, white shirt, and patterned tie. He is seated in a high-backed, upholstered chair, looking directly at the camera with a serious expression. The portrait is framed by a decorative border with a repeating geometric pattern.

هیچ وسیله ای مکارانه تر و اطمینان بخش تر برای واژگون کردن پایه های موجود جامعه، بهتر از خراب و بی اعتبار کردن پول رایج آن نیست. این فرآیند همه نیروهای نهانی قانون اقتصادی را در جهت انهدام و ویرانی به کار می گیرد و آن را به صورتی عملی می کند که یک نفر از یک میلیون نفر قادر به تشخیص آن نیست.

جان مینارد کینز (۱۸۸۳-۱۹۴۶)

THE MOST SINISTER OF ALL TAXES IS THE
INFLATION TAX AND IT IS THE MOST REGRESSIVE.
IT HITS THE POOR AND THE MIDDLE CLASS.

Ron Paul



نادرست ترین نوع مالیات، مالیات تورمی است که
اقلشار ضعیف و طبقه متوسط را هدف می گیرد.

 @EconomySoltani

www.facebook.com/RonPaulQuoteVisualizations

مالیات تورمی در اقتصاد ایران

