

رسالة محمد



معاونت پژوهش و فناوری

به نام خدا

مشور اخلاق پژوهش

بایاری از خداوند سبحان و اعتماد به این که عالم محضر خداست و همواره ناظر بر اعمال انسان و به منظور پاس داشت مقام بلند دانش و پژوهش و نظریه اهمیت جایگاه دانشگاه در اعتلای فرهنگ و تمدن بشری، مادانشجویان و اعضاء هیات علمی واحدهای دانشگاه آزاد اسلامی متعهد می گردیم اصول زیر را در انجام فعالیت های پژوهشی مد نظر قرار داده و از آن تخطی نکنیم:

۱- اصل برائت: التزام به برائت جویی از هرگونه رفتار غیر حرفه ای و اعلام موضع نسبت به کسانی

که حوزه علم و پژوهش را به شائبه های غیر علمی می آلائند.



دانشگاه آزاد اسلامی

واحد تهران مرکزی

دانشکده اقتصاد، گروه اقتصاد و نظری

پایان نامه برای دریافت درجه ی کارشناسی ارشد (M.A)

گرایش: توسعه و برنامه ریزی

عنوان:

تأثیر نوسانات نرخ ارز بر
صادرات محصولات کشاورزی در ایران

استاد راهنما:

آقای دکتر هادی محمدی

استاد مشاور:

آقای دکتر شهریار نصابیان

پژوهشگر:

حسین بهروزی نژاد

۲- اصل رعایت انصاف و امانت: تعهد به اجتناب از هرگونه جانب داری غیر علمی و حفاظت از اموال، تجهیزات و

منابع در اختیار.

۳- اصل ترویج: تعهد به رواج دانش و اشاعه نتایج تحقیقات و انتقال آن به همکاران علمی و دانشجویان به غیر از مواردی که

منع قانونی دارد.

۴- اصل احترام: تعهد به رعایت حریم ها و حرمت ها در انجام تحقیقات و رعایت جانب نقد و خودداری از هرگونه

حرمت شکنی.

۵- اصل رعایت حقوق: التزام به رعایت کامل حقوق پژوهشگران و پژوهیدگان (انسان، حیوان و نبات) و سایر

صاحبان حق.

۶- اصل رازداری: تعهد به صیانت از اسرار و اطلاعات محرمانه افراد، سازمان ها و کشور و کلیه افراد و نهادهای مرتبط با

تحقیق.

۷- اصل حقیقت جویی: تلاش در راستای پی جویی حقیقت و وفاداری به آن و دوری از هرگونه پنهان سازی حقیقت.

۸- اصل مالکیت مادی و معنوی: تعهد به رعایت کامل حقوق مادی و معنوی دانشگاه و کلیه همکاران پژوهش.

۹- اصل منافع ملی: تعهد به رعایت مصالح ملی و در نظر داشتن پیشبرد و توسعه کشور در کلیه مراحل پژوهش.

تقدیر :

بسیار مایه مسرت و خرسندی است که به لطف خدای متعال تحقیق حاضر مورد استقبال اهل دانش و تحقیق

قرار بگیرد هر چند این تحقیق خالی از اشکال نمی باشد لکن با تمامی کم و کاست آن که مطمئناً نزد خوانندگان بر

ارزش آن می افزاید آن را به جامعه علمی و طالبان علم و دانش و همه کسانی که تحقیق این جانب را شایسته

مطالعه می دانند تقدیم می کنم.

امید است مورد قبول بزرگان و دوست داران علم و دانش و مراکز علمی پژوهشی واقع گردد.

تشکر و قدردانی:

اینجانب از تمامی استادان و دانشجویان عزیزی که نکات و راهنمایی های لازم را جهت تکمیل این تحقیق به بنده یادآوری نموده اند تقدیر و تشکر می نمایم.

به ویژه نهایت سپاسگذاری و قدردانی را از اساتید ارجمند جناب آقای دکتر هادی محمدی و همچنین جناب آقای دکتر شهریار نصابیان که در طی مراحل آماده سازی این تحقیق بنده را بی نهایت مورد لطف و راهنمایی های خویش قرار داده اند سپاسگذاری می نمایم.

حسین بهروزی نژاد

تعهدنامه اصالت پایان نامه

اینجانب حسین بهروزی نژاد دانش آموخته مقطع کارشناسی ارشد ناپیوسته در رشته

اقتصاد توسعه و برنامه ریزی که در تاریخ ۹۳/۱۱/۲۸ از پایان نامه خود تحت عنوان

" تأثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات محصولات کشاورزی در ایران "

با کسب نمره هفده و درجه بسیار خوب دفاع نموده ام. بدینوسیله متعهد می شوم:

۱- این پایان نامه حاصل تحقیق و پژوهش انجام شده توسط اینجانب بوده و در مواردی که از دستاوردهای علمی و پژوهشی دیگران (اعم از پایان نامه، کتاب، مقاله و ...) استفاده نموده ام، مطابق ضوابط و رویه موجود، نام منبع مورد استفاده و سایر مشخصات آن را در فهرست مربوطه ذکر و درج کرده ام.

۲- این پایان نامه قبلاً برای دریافت هیچ مدرک تحصیلی (همسطح، پایین تر یا بالاتر) در سایر دانشگاه ها و موسسات آموزش عالی ارائه نشده است.

۳- چنانچه بعد از فراغت از تحصیل، قصد استفاده و هرگونه بهره برداری اعم از چاپ کتاب، ثبت اختراع و ... از این پایان نامه داشته باشم، از حوزه معاونت پژوهشی واحد مجوزهای مربوطه را اخذ نمایم.

۴- چنانچه در هر مقطع زمانی خلاف موارد فوق ثابت شود، عواقب ناشی از آن را می پذیرم و واحد دانشگاهی مجاز است با اینجانب مطابق ضوابط و مقررات رفتار نموده و در صورت ابطال مدرک تحصیلی ام هیچگونه ادعایی نخواهم داشت.

نام و نام خانوادگی:

تاریخ و امضاء:

بسمه تعالی

در تاریخ ۹۳/۱۱/۲۸

دانشجوی کارشناسی ارشد آقای حسین بهروزی نژاد از پایان نامه خود
دفاع نموده و با نمره ی ۱۷ بحروف (هفده) و با درجه ی بسیار خوب مورد تصویب
قرار گرفت .

امضا استاد راهنما

بسمه تعالی

دانشکده اقتصاد و حسابداری

(این چکیده به منظور چاپ در پژوهش نامه دانشگاه تهیه شده است)

نام واحد دانشگاهی: تهران مرکزی کد واحد: ۱۰۱	کد شناسایی پایان نامه: ۱۰۱۲۰۹۱۲۹۳۱۰۱۶
عنوان پایان نامه: تأثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات محصولات کشاورزی در ایران	
نام و نام خانوادگی دانشجو: حسین بهروزی نژاد شماره دانشجویی: ۹۱۰۸۳۹۱۱۶ رشته تحصیلی: اقتصاد (توسعه و برنامه ریزی)	تاریخ شروع پایان نامه: نیمسال دوم ۹۲-۹۳ تاریخ اتمام پایان نامه: ۹۳/۱۱/۲۸
استاد/استاد راهنما: دکتر هادی محمدی استاد/استادان مشاور: دکتر شهریار نصایبان	
<p>چکیده پایان نامه (شامل خلاصه، اهداف، روش های اجرا و نتایج به دست آمده):</p> <p>تولید و به کارگیری دانش در مشاهدات و مسائل تجربی، پایه و اساس تحول و توسعه می باشد. در این میان نخستین رسالت دانشگاهها و مراکز علمی، پژوهشی همان تحقیق و توسعه و گسترش دانش می باشد. از طرفی صادرات یکی از مهمترین ملاک های رشد و توسعه هر کشوری می باشد و کشور ما نیز از این حیث در بخش محصولات کشاورزی از جایگاه قابل قبولی برخوردار می باشد و تحقیق و پژوهش در این زمینه امری بدیهی و مهم به شمار می آید.</p> <p>در تحقیق حاضر که به بررسی تأثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات محصولات کشاورزی اشاره شده است سعی شده است با استفاده از روش های علمی این رابطه و همبستگی میان متغیرهای مورد مطالعه (نرخ ارز و نوسانات آن و صادرات محصولات کشاورزی) بررسی و تحلیل می گردد. در این تحقیق سعی شده است از روش های اقتصادسنجی و رگرسیون متغیرهای مستقل و وابسته به بررسی میزان همبستگی آنها از طریق نرم افزارهای SPSS و eviews پردازیم. مطالعات بر روی محصولات چای، پسته و پرتقال و نارنگی انجام شده است.</p> <p>واژگان کلیدی: نوسانات نرخ ارز، صادرات محصولات کشاورزی</p>	

مناسب است

نظر استاد راهنما برای چاپ در پژوهشنامه دانشگاه

مناسب نیست

امضا استاد راهنما:

فهرست مطالب

۱	فصل اول : مقدمه
۲	بیان مسئله تحقیق
۴	اهمیت موضوع تحقیق و انگیزه ی انتخاب آن
۶	سوالات و فرضیه های تحقیق (بیان روابط بین متغیرها مورد مطالعه)
۷	چارچوب نظریه تحقیق
۱۰	مدل تحقیق
۱۱	متغیرها و واژه های کلیدی
۱۱	روش گرد آوری اطلاعات
۱۱	روش تجزیه و تحلیل
۱۲	جامعه آماری و حجم آن
۱۳	فصل دوم : مطالعات نظری
۱۶	نرخ ارز و نوسانات نرخ ارز
۱۷	پیامدهای نوسانات نرخ ارز
۱۹	دلایل نوسانات نرخ ارز
۲۱	صادرات
۲۲	لزوم توجه به صادرات
۲۳	عوامل مؤثر بر صادرات
۲۳	عوامل فنی و علمی
۲۳	عوامل اجتماعی و فرهنگی
۲۳	عوامل حقوقی و سیاسی

۲۴	ترویج فرهنگ صادرات
۲۴	کشاورزی ایران و صادرات کشاورزی ایران
۲۶	عوامل مؤثر بر صادرات کشاورزی ایران
۲۸	نتایج نوسانات نرخ ارز بر صادرات
۳۰	پیشینه تحقیق
۳۶	فصل سوم: روش شناسی تحقیق
۳۷	مقدمه
۳۷	جامعه آماری
۳۸	نمونه آماری
۳۹	فصل چهارم: برآورد و تخمین مدل
۴۰	مقدمه
۴۱	آزمون ریشه واحد
۴۳	مدلسازی نرخ ارز
۴۵	مدل اول
۴۵	تخمین مدل بر اساس روش خود رگرسیون برداری (VAR)
۴۸	بررسی ثبات مدل
۴۹	بررسی علیت بین متغیرها
۵۰	هم انباشتگی
۵۱	تجزیه واریانس
۵۴	مدل دوم
۵۵	تخمین مدل بر اساس روش خود رگرسیون برداری (VAR)

۵۷ بررسی ثبات مدل
۵۸ بررسی علیت بین متغیرها
۵۹ هم انباشتگی
۵۹ تجزیه واریانس
۶۲ مدل سوم
۶۲ تخمین مدل بر اساس روش خود رگرسیون برداری (VAR)
۶۵ بررسی ثبات مدل
۶۵ بررسی علیت بین متغیرها
۶۶ هم انباشتگی
۶۷ تجزیه واریانس
۶۹ مدل چهارم
۶۹ تخمین مدل بر اساس روش خود رگرسیون برداری (VAR)
۷۲ بررسی علیت بین متغیرها
۷۳ هم انباشتگی
۷۴ تجزیه واریانس
۷۷ فصل پنجم: نتایج و پیشنهادات
۸۱ پیشنهادات
۸۲ فهرست منابع
۸۳ منابع خارجی
۸۴ پیوست ها:
۸۴ نمودار ها:

فهرست جداول

جدول ۱ - خلاصه ای از مطالعات انجام شده پیرامون نوسانات نرخ ارز و صادرات	۳۴
جدول ۲- نتایج آزمون مانایی در سطح بر اساس آزمون دیکی فولر تعمیم یافته... ۴۲	۴۲
جدول ۳- نتایج آزمون مانایی بر اساس آزمون دیکی فولر تعمیم یافته..... ۴۳	۴۳
جدول ۴- مدلسازی نرخ ارز..... ۴۴	۴۴
جدول ۵- آزمون EGARCH..... ۴۴	۴۴
جدول ۶- نتایج تعیین وقفه بهینه برای مدل اول (چای)..... ۴۶	۴۶
جدول ۷- نتایج تخمین مدل اول (چای) پس از تعیین وقفه ی بهینه..... ۴۶	۴۶
جدول ۷-..... ۵۰	۵۰
جدول ۸-..... ۵۰	۵۰
جدول ۹- تجزیه واریانس برای XT..... ۵۳	۵۳
جدول ۱۱-..... ۵۶	۵۶
جدول ۱۲-..... ۵۸	۵۸
جدول ۱۳-..... ۵۹	۵۹
جدول ۱۴- تجزیه واریانس برای XN..... ۶۰	۶۰
جدول ۱۵- نتایج تعیین وقفه بهینه..... ۶۲	۶۲
جدول ۱۶-..... ۶۳	۶۳
جدول ۱۷-..... ۶۶	۶۶
جدول ۱۸-..... ۶۶	۶۶

جدول ۱۹- تجزیه واریانس برای XPS	۶۷
جدول ۲۰- نتایج تعیین وقفه بهینه	۷۰
جدول ۲۱-	۷۰
جدول ۲۲-.	۷۳
جدول ۲۳-	۷۳
جدول ۲۴- تجزیه واریانس برای XPR	۷۴
جدول ۲۶- آمار و اطلاعات مربوط به صادرات محصولات پسته پرتغال و نارنگی (آمار به هزار دلار)	۱۰۳
جدول ۲۵- مربوط به اطلاعات LN نرخ ارز GDP ایران و صادرات محصولات مختلف	۱۰۵

فهرست نمودارها

نمودار ۱-..... ۴۹

نمودار ۲-..... ۵۸

نمودار ۳-..... ۶۵

نمودار ۴-..... ۷۲

فصل اول

مقدمه

بیان مسئله تحقیق

بخش بازرگانی خارجی از مهمترین اجزای نظام های اقتصادی محسوب می گردد. که از دیرباز نقش مهمی را در توسعه اقتصادی ایفا کرده است. و بسیاری از اقتصاد دانان نظیر آدام اسمیت ، ریکاردو و جان استوارت میل آن را موتور رشد اقتصادی دانسته اند. تجربه ی بسیاری از کشورها نشان می دهد بهره وری در اقتصادهای باز بسیار سریع تر از بهره وری در اقتصادهای بسته رشد می کند. و توسعه صادرات سبب افزایش GDP و باعث تخفیف معضل بیکاری می گردد و کمک خارجی به تعادل نظام پرداخت ها کمک می کند.

آثار نامطلوب وابستگی اقتصاد ایران به نفت و همچنین کاهش ذخایر نفتی و بی اطمینانی به آینده بازار جهانی نفت سبب شده است که سیاست گذاران اقتصادی کشور بیش از پیش بر لزوم رهایی از اقتصاد تک محصولی و پیش رفتن به سوی افزایش صادرات غیر نفتی تاکید کنند که یکی از مهمترین اجزاء بدنه اقتصاد بدون نفت ایران توجه به صادرات بخش کشاورزی می باشد.

قابلیت های فراوان کشور در زمینه تولید و عرضه انواع مختلفی از تولیدات کشاورزی سبب شده است حجم عمده ای از محصولات غیر نفتی کشور را این محصولات به خود اختصاص دهند. از این رو صدور محصولات کشاورزی منشأ مهمی از تزریق ارز به بدنه اقتصاد کشور به شمار می رود و از سوی دیگر سطح گسترده ی ارتباطات پسین و پیشین تولیدات کشاورزی باعث شده که

تولید و مبادله این محصولات به عاملی در جهت رشد فعالیت های وابسته اعم از صنعتی و خدماتی تبدیل شود.

متأسفانه کوچک بودن اقتصاد ایران سبب گردیده است که در عرصه ی جهانی و تجارت بین الملل به عنوان گیرنده ی قیمت عمل کرده و هیچ گونه تاثیری بر فعالیت های اقتصادی نداشته باشد و تغییرات نرخ ارز ، پیوسته قیمت های نسبی کالاهای وارداتی و صادراتی را به شدت تحت تاثیر قرار دهد. در بسیاری از موارد این تاثیرات نتایج منفی بر فعالیت های اقتصادی داشته است.

از طرفی هرگاه صحبت از صادرات غیر نفتی شده ، ناگاه صادرات کشاورزی و سنتی به ذهن خطور می کند چرا که در طی سه دهه ی گذشته ، صادرات کشاورزی و سنتی به طور متوسط بیش از هفتاد درصد کل صادرات غیر نفتی را شامل می شده و از طرفی نوسانات نرخ ارز طبق آمار و ارقام لطماتی به رشد صادرات کشاورزی در کشورمان می زده است. لذا در تحقیق مزبور به دو عامل و شاخص توجه شده است:

۱. رفتار نرخ واقعی ارز یعنی نوسانات نرخ ارز

۲. انحراف نرخ واقعی ارز نسبت به مسیر تعادلی بلند مدت آن.

از همه مهمتر در سال های اخیر، پایداری ، ثبات و تنظیم صحیح نرخ واقعی ارز از جمله شرایط لازم برای بهبود عملکرد اقتصاد کشور های کم تر توسعه یافته می باشد. به طوری که مطالعات انجام گرفته نشان می دهد ثبات و تنظیم صحیح نرخ واقعی ارز باعث پیشرفت و رشد اقتصادی و روشن شدن موتور توسعه صادرات در کشور های آسیای جنوب شرقی شده است . در ضمن صادرات کشور های در حال توسعه غالباً به یک یا چند محصول عمده کشاورزی و منابع طبیعی محدود می گردد که میزان آن بین هشتاد تا نود درصد ارزش کل صادرات است. و بنابراین با شروع نوسانات قیمتی در بازار جهانی آن محصولات ، تراز پرداخت های کشور مربوطه دچار عدم موازنه می شود.

کشور ما نیز جزو همین کشورهاست بنابراین توجه بیشتر به صادرات بیشتر و دسترسی به بازار جدید را دارا می باشند ضروری بنظر می رسد به هر دو حال نرخ واقعی ارز بدون شک یکی از شاخص های اساسی و بنیادین در تعیین درجه ی رقابت بین المللی و تبیین وضعیت داخلی اقتصاد آن کشور به شمار می رود. آشفتگی و نوسان در عملکرد این شاخص از یک طرف تبیین عدم تعادل در اقتصاد و از سوی دیگر علت بی ثباتی بیشتر محسوب می گردد.

سیاست های مربوط به نرخ ارز ، تاثیر بسزایی بر متغیرهای کلان و بخش های مختلف اقتصاد خواهد داشت. در خصوص رابطه بخش کشاورزی و صادرات آن به منزله یکی از بخش های عمده و مولد اقتصاد کشور که حجم بالایی از اشتغال و تولید ملی را به خود اختصاص داده است نیز بررسی ها نشان داده است که از این اثرات بی بهره نخواهد بود.

به هر حال هم مطالعات تئوریک و هم مطالعات تجربی و استراتژیک بیان گر این مهم است که نوسان نرخ ارز منجر به افزایش ریسک و عدم قطعیت شده لذا می بایستی اثرات این بی اطمینانی ناشی از نوسانات نرخ ارز بر صادرات محصولات کشاورزی و مرکبات را مورد بررسی و تجزیه و تحلیل قرار داد که آیا سبب کاهش صادرات این بخش مهم اقتصاد می گردد یا خیر؟

اهمیت موضوع تحقیق و انگیزه ی انتخاب آن

نام ایران به عنوان کشور چهار فصل ، وجود اقلیم های مختلف با شرایط مختلف را در ذهن تداعی می کند. بر خورداری از ۲۹ میلیون هکتار اراضی مزروعی ، ۱۲ میلیون هکتار جنگل ، قریب به ۹۵ میلیون هکتار مرتع و دسترسی به ۱۲۰ میلیارد متر مکعب آب از پتانسیل های این بخش است. از طرفی بخش کشاورزی به عنوان یکی از بخشهای اقتصادی مهم در کشور می باشد که شناخت عوامل موثر بر رشد و توسعه این بخش از اهمیت خاصی برخوردار است. چرا که بخش کشاورزی به عنوان بخش پایه و استراتژیک اقتصاد ، تأمین

کننده ی غذا و مواد اولیه برای سایر بخش هاست و همچنین چنانچه مبادلات خارجی و صادرات این بخش به نحو احسن اجرا گردد زمینه ی ارز آوری را نیز فراهم می کند.

از جهت دیگر، نرخ ارز نیز به عنوان یکی از متغیر های اصلی اقتصاد کلان تاثیر بسیار زیادی در رشد و توسعه یا عقب ماندگی و عدم توسعه هر یک از بخش های اقتصادی از جمله کشاورزی دارد. و لذا مبانی نظری سیاست های آزاد سازی تجاری و عوامل موثر بر آن منجمله نرخ ارز و نوسانات آن بر ساختار اقتصاد برون نگر و حتی درون گر تاثیر بسیاری دارد. لذا توجه بیشتر به صادرات کشاورزی به ویژه آن دسته از محصولاتی که در آینده، قابلیت صادرات بیشتر و دسترسی به بازارهای جدید را دارا می باشند ضروری به نظر می رسد. همچنین توجه بیشتر در زمینه ی اجرای سیاست های مناسب برای معرفی بهتر این محصولات و بهبود شرایط صادرات آن امری غیر قابل اجتناب است.

ضمن اینکه، با توجه به تاثیر پذیری تجارت جهانی محصولات مختلف به ویژه تولیدات کشاورزی از تغییرات نرخ ارز در سطح دنیا، این فاکتور به عنوان یکی از عوامل مهم و تاثیر گذار در تجارت جهانی مطرح شده و نقش قابل توجهی در این زمینه ایفا می کند.

یکی از دلایل اهمیت این سر فصل در اقتصادمان، سهم بالای این بخش از کل صادرات غیر نفتی و پتانسیل های بالقوه آن است یعنی تنوع آب و هوایی کم نظیر کشور، امکانات قابل توجه در خاک مناسب کشاورزی. از طرفی توجه به اینکه بخش مذکور بستر فعالیت اقتصادی نزدیک به نیمی از جمعیت کشور است و همچنین وابستگی کمتر این بخش به تکنولوژی پیچیده به نظر می رسد، تحقیق و بررسی پیرامون عواملی که صادرات این بخش را دست خوش تغییرات قرار می دهد ضرورتی بسیار مهم می باشد. از طرفی دیگر چون