

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



دانشگاه زابل

مدیریت تحصیلات تکمیلی

دانشکده کشاورزی

گروه اقتصاد کشاورزی

پایان نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد

در رشته اقتصاد کشاورزی

بررسی اثر نااطمینانی ناشی از نوسانات نرخ ارز بر ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۱۳۵۷-۱۳۸۹ در ایران

استاد راهنما:

دکتر ماشاله سالارپور

اساتید مشاور:

دکتر حمید محمدی

دکتر سامان ضیائی

تهیه و تدوین:

ام البنین آبگون

بهمن ماه ۱۳۹۲

تقدیم بہ

پیشگاہ قلب عالم امکان، دادگستر جهان، منجی مستضعفان، ہمدی موعود،

صاحب الزمان (عج)

تقدیم بہ کوہ صبر و استقامت

مددِ حمتکش و مہربانم کہ در تمامی محظرات زندگی و تحصیل را بہنا و مشوق من بودہ و تمامی موفقیات ہائی کہ تا بہ اکنون کسب کردہ ام بدیون زحمت بی شائبہ ایشان است

تقدیم بہ مادر مہربانم

آن عاشق بی ریا کہ با مہر و لطف، پرستار و جودم گشت
بر نگاہم بخند زد صحنہ خالی روحم را با مہر و عشق آشنا نمود.
مادر صبورم کہ شبی آسودہ خاطر از فرادای فرزندانش نخفت.

تقدیم بہ برادر و خواہران بزرگوارم آنان کہ ہموارہ مشوق و پشتیبان من بودند و ہستند

تقدیم بہ ہمسفر عزیزم بہ خاطر فداکاری، صبر و سکیمایی بی دینش و بہ خاطر تمام خطائی کہ از او دینچ کردم.

و تقدیم بہ کسانی کہ دوستان دارم و یار و یاور من در این پایان نامہ بودند.

شکر و قدردانی

پاس بی نهایت خدای را که دیای بی تنهای بخشش است و بال فضل، بر کائنات کثوده و سایه لطف بر بندگان کسترده و بامنت خود، مرابه زینت ایمان آراسته و در خیمه لطف مثل داده است. چگونگی شکر او را گویم که منت را بر من تمام کرده و از سر رحمت خود، مراد زمره جویندگان علم و دانش قرار داده است. من چگونه نوای لک الحمد سرد هم که این نوای ارادت، خود از بیشمار نعمت های اوست و محتاج لک الحمدی دیگر. تمام مہابت من در طول تحصیل، نه دست یازیدن به درجہ ای از دانش، بلکه فراسوی آن تلذذ نزد استادانی بوده است که خود دریایی از معرفت بودند و سم من پر توی از تشعشع معرفت ایشان بر اندیشه بوده است. در این رهگذر، به رسم ادب خود را ملزم می دانم که با تواضع تام و از صمیم قلب شکر و سپاس خالصانه خود را از استاد راهنمای گرانقدرم آقای دکتر ماشاء اللہ سالار پور عرضہ دارم، که بدون ہمراہی این عزیز بیچگاہ این تحقیق بہ سر انجام نمی رسید. بہخنین از اساتید مشاورم آقایان دکتر حمید محمدی و دکتر سلمان ضیائی کہ طی انجام این پژوهش یاری ام دادند شکر کنم. بہخنین از دوستان عزیزم مرضیہ قربانی، حدیث کاوند، سید صدیقہ احمدزادہ، زہرا کاوسی، آزادہ حق نگہدار و تمامی دوستانی کہ طی این مدت با شکیبائی تام از ہراز محبت و ہیکاری دینغ نموده اند و بہ عنوان مختلف یار و یاورم بودند سپاسگزارم.

ام البنین آبگون

بہمن ماہ سال ۱۳۹۲

چکیده

طی سال‌های اخیر بخش کشاورزی، تحت تأثیر سیاست‌های تعدیل و تثبیت قرار گرفته و وجود نوسانات در نرخ ارز داخلی منجر به نااطمینانی و اثرات عمده بر ارزش افزوده این بخش گردیده است. با توجه به اهمیت مساله فوق در مطالعه حاضر اثرات نوسانات نرخ ارز واقعی بر ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۸۹-۱۳۵۷ بررسی شده است. جهت دسترسی به این هدف ابتدا نوسانات نرخ ارز واقعی در قالب مدل GARCH، الگوسازی و سپس به کمک مدل ARDL، اثرات کوتاه‌مدت و بلندمدت آن در کنار متغیرهایی چون نرخ واقعی ارز، ارزش افزوده بخش نفت، ارزش افزوده بخش صنعت، اشتغال بخش کشاورزی و موجودی سرمایه بر بخش کشاورزی مورد بررسی قرار گرفته است. نتایج مطالعه حاضر نشان می‌دهد که در کوتاه‌مدت و بلندمدت بیشترین اثر بر روی ارزش افزوده بخش کشاورزی مربوط به متغیر نوسانات نرخ واقعی ارز می‌باشد. به طوری که با افزایش نوسانات نرخ واقعی ارز به میزان ۱۰ درصد ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره کوتاه‌مدت و بلندمدت به ترتیب به میزان ۴/۹ و ۸/۸ درصد کاهش می‌یابد. بعد از متغیر فوق، ارزش افزوده دو بخش نفت و صنعت دارای بیشترین اثر بر ارزش افزوده بخش کشاورزی می‌باشند. همچنین نتایج مطالعه حاضر نشان می‌دهد که اگر چه نرخ واقعی ارز طی دوره کوتاه‌مدت بر ارزش افزوده بخش کشاورزی اثر معنی‌داری نداشته است با این وجود متغیر فوق طی دوره بلندمدت اثری مثبت و معنی‌دار بر ارزش افزوده بخش کشاورزی داشته است. نتایج بیان‌گر اثر مثبت و مستقیم رشد اشتغال کشاورزی و نیز رشد موجودی سرمایه بخش کشاورزی بر ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره کوتاه‌مدت و بلندمدت می‌باشند به طوری که رشد ۱۰ درصدی در دو متغیر فوق ارزش افزوده بخش کشاورزی را طی دوره کوتاه‌مدت به ترتیب به میزان ۰/۷ و ۰/۵ درصد و طی دوره بلندمدت به میزان ۱/۲ و ۰/۹ درصد افزایش می‌دهد. در نهایت نیز نتایج مربوط به الگوی تصحیح خطا بیان‌گر آن است که سرعت تعدیل و حرکت به سمت تعادل بلندمدت در الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی به کندی صورت می‌گیرد. به عبارت دیگر اگر شوکی به مدل وارد شود زمانی به اندازه دو دوره لازم است تا الگو خود را تعدیل نموده و دوباره به تعادل اولیه باز گردد.

کلمات کلیدی: ارزش افزوده بخش کشاورزی، نوسانات نرخ ارز، مدل GARCH، الگوی ARDL.

فهرست مطالب

| صفحه | عنوان |
|------|---|
| | فصل اول: مقدمه |
| ۲ | ۱-۱- مقدمه..... |
| ۲ | ۱-۲- تعریف مسأله..... |
| ۴ | ۱-۳- اهمیت موضوع..... |
| ۶ | ۱-۴- اهداف..... |
| ۶ | ۱-۵- فرضیات..... |
| ۶ | ۱-۶- جایگاه بخش کشاورزی در اقتصاد ملی..... |
| ۷ | ۱-۷- مبانی نظری و تعریف مفاهیم اصلی تحقیق..... |
| ۷ | ۱-۷-۱- مفهوم نرخ ارز..... |
| ۷ | ۱-۷-۲- نرخ ارز اسمی و واقعی..... |
| ۸ | ۱-۷-۳- اصول و معیارهای تعیین نرخ ارز..... |
| ۹ | ۱-۷-۴- چگونگی تعیین نرخ ارز واقعی تعادلی..... |
| ۱۱ | ۱-۷-۵- عوامل مؤثر بر نرخ ارز واقعی تعادلی..... |
| ۱۱ | ۱-۷-۵-۱- وقایع، رویدادها و سیاست‌های اقتصادی سایر کشورها..... |
| ۱۱ | ۱-۷-۵-۲- دخالت‌های دولت..... |
| ۱۱ | ۱-۷-۵-۳- تغییرات بهره‌وری..... |
| ۱۲ | ۱-۷-۵-۴- نرخ بهره و نقل و انتقال سرمایه..... |
| ۱۲ | ۱-۷-۵-۵- سیاست‌های پولی..... |
| ۱۳ | ۱-۷-۵-۶- سیاست‌های مالی..... |
| ۱۳ | ۱-۷-۵-۷- سیاست‌های ارزی..... |
| ۱۳ | ۱-۷-۶- چگونگی تعیین نرخ ارز در ایران..... |

- ۱۴-۷-۷-۱- روند تغییرات نرخ ارز در ایران طی دوره ۱۳۸۹-۱۳۵۷.....
- ۱۵-۷-۸-۱- ارزش افزوده بخش کشاورزی.....
- ۱۸-۷-۹-۱- عدم اطمینان ناشی از نوسانات نرخ ارز.....
- ۱۹-۷-۱۰-۱- نحوه اثرگذاری عدم اطمینان ناشی از نوسانات نرخ ارز بر سطح رفاه کشاورزان.....
- ۱۹-۷-۱۱-۱- نحوه اثرگذاری عدم اطمینان نوسانات نرخ ارز بر صادرات محصولات کشاورزی.....
- ۲۰-۷-۱۲-۱- نحوه اثرگذاری عدم اطمینان نرخ ارز بر مکانیزم قیمت محصولات کشاورزی.....
- ۲۱-۷-۱۳-۱- نحوه اثرگذاری عدم اطمینان ناشی از نرخ ارز بر ارزش افزوده بخش کشاورزی.....
- ۲۱-۸-۱- ساختار پایان نامه.....

فصل دوم: مروری بر مطالعات انجام شده

- ۲۴-۲-۱- مقدمه.....
- ۲۴-۲-۲- مطالعات داخلی و خارجی انجام شده.....
- ۲۵-۲-۱-۲- مطالعات انجام شده در داخل کشور.....
- ۳۰-۲-۲-۲- مطالعات انجام شده در خارج کشور.....
- ۳۵-۲-۳- جمع بندی مطالعات انجام شده.....

فصل سوم: مواد و روش‌ها

- ۳۸-۳-۱- مقدمه.....
- ۳۸-۳-۲- مفهوم پایایی و ناپایایی سری های زمانی.....
- ۴۰-۳-۳- آزمون های تعیین پایایی و ناپایایی سری های زمانی.....
- ۴۱-۳-۳-۱- آزمون دیکی- فولر (DICKY – FULLER TEST).....
- ۴۲-۳-۳-۲- آزمون دیکی- فولر تعمیم یافته (AUGMENTED DICKY – FULLER TEST).....
- ۴۲-۳-۳-۳- آزمون فیلیپس- پرون (PHILLIPS – PERRON TEST).....
- ۴۳-۳-۴- همجمعی یا همگرایی.....
- ۴۴-۳-۵- روش انجام آزمونهای همجمعی.....
- ۴۵-۳-۵-۱- آزمون انگل- گرنجر و انگل- گرنجر تعمیم یافته.....
- ۴۶-۳-۵-۲- الگوی تصحیح خطا (ECM).....
- ۴۷-۳-۵-۳- آزمون یوهانسن.....

| | |
|----|---|
| ۴۹ | اندازه‌گیری نوسانات ناشی از نااطمینانی نرخ واقعی ارز |
| ۵۰ | ۳-۶-۱- روش برآورد واریانس یا انحراف معیار نرخ واقعی ارز |
| ۵۱ | ۳-۶-۲- روش خود رگرسیون واریانس ناهمسانی (ARCH) |
| ۵۳ | ۳-۷- برآورد تابع ارزش افزوده بخش کشاورزی (VAA) |
| ۵۴ | ۳-۸- مدل خود توضیح با وقفه‌های توزیعی گسترده (ARDL) |
| ۵۶ | ۳-۹- تعیین تعداد وقفه‌های بهینه در مدل ARDL |
| ۵۷ | ۳-۹-۱- معیار آکائیک (AIC) |
| ۵۷ | ۳-۹-۲- معیار شوارتز-بیزین (SBC) |
| ۵۷ | ۳-۹-۳- معیار حنان-کوئین (HQC) |
| ۵۸ | ۳-۹-۴- آزمون نسبت درست‌نمایی (TBC) |
| ۵۹ | ۳-۹-۵- الگوی تصحیح خطای برداری |
| ۵۹ | ۳-۱۰- داده‌ها و اطلاعات مورد نیاز |
| ۶۰ | ۳-۱۱- روش جمع‌آوری داده‌ها و اطلاعات |

فصل چهارم: نتایج و بحث

| | |
|----|---|
| ۶۲ | ۴-۱- مقدمه |
| ۶۲ | ۴-۲- اندازه‌گیری نوسانات ناشی از نااطمینانی نرخ واقعی ارز |
| ۶۴ | ۴-۳- تصریح الگوی تجربی ارزش افزوده بخش کشاورزی |
| ۶۶ | ۴-۴- آزمون پایایی متغیرهای الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی |
| ۶۹ | ۴-۵- برآورد الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی |
| ۷۶ | ۴-۶- آزمون ثبات پارامترها |

فصل پنجم: نتیجه‌گیری و پیشنهادات

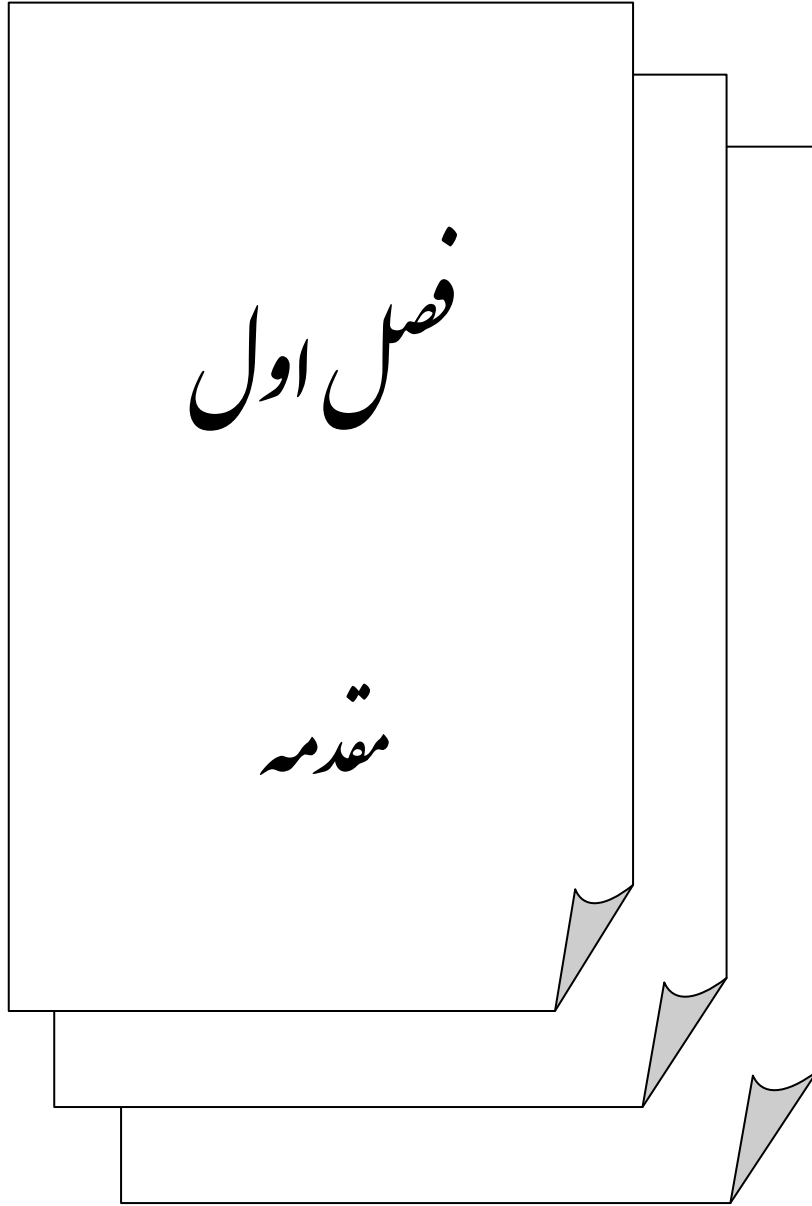
| | |
|----|-----------------------|
| ۸۰ | ۵-۱- نتیجه‌گیری |
| ۸۲ | ۵-۲- پیشنهادات |
| ۸۵ | منابع و مآخذ |

فهرست جداول

| عنوان | صفحه |
|---|------|
| جدول ۱-۱ روند تغییرات ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۱۳۵۷-۱۳۸۹ در ایران..... | ۱۷ |
| جدول ۱-۴-۱ آزمون LM جهت بررسی احتمال وجود اثرات ARCH..... | ۶۳ |
| جدول ۲-۴-۲ نتایج مربوط به برآورد مدل GARCH(2,1)..... | ۶۳ |
| جدول ۳-۴-۳ بررسی ایستایی متغیرهای مورد استفاده در الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی با استفاده از آزمون ADF..... | ۶۷ |
| جدول ۴-۴-۴ بررسی ایستایی متغیرهای مورد استفاده در الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی با استفاده از آزمون KPSS..... | ۶۸ |
| جدول ۵-۴-۵ نتایج حاصل از برآورد الگوی پویا (۱,۰,۰,۰,۰,۰,۰) ARDL الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی..... | ۷۱ |
| * معنی‌دار در سطح ۱ درصد ** معنی‌دار در سطح ۵ درصد *** معنی‌دار در سطح ۱۰ درصد ماخذ: یافته‌های تحقیق..... | ۷۱ |
| جدول ۶-۴-۶ نتایج مولفه‌های اعتبارسنجی (۱,۰,۰,۰,۰,۰,۰) ARDL الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی..... | ۷۲ |
| ماخذ: یافته‌های تحقیق..... | ۷۲ |
| جدول ۷-۴-۷ نتایج حاصل از برآورد رابطه بلندمدت (۱,۰,۰,۰,۰,۰,۰) ARDL الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی..... | ۷۵ |
| * معنی‌دار در سطح ۱ درصد ** معنی‌دار در سطح ۵ درصد *** معنی‌دار در سطح ۱۰ درصد ماخذ: یافته‌های تحقیق..... | ۷۵ |
| جدول ۸-۴-۸ نتایج حاصل از برآورد الگوی تصحیح خطا (۱,۰,۰,۰,۰,۰,۰) ARDL الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی..... | ۷۶ |
| * معنی‌دار در سطح ۱ درصد ** معنی‌دار در سطح ۵ درصد *** معنی‌دار در سطح ۱۰ درصد ماخذ: یافته‌های تحقیق..... | ۷۶ |

فهرست نمودارها

| صفحه | عنوان |
|---------|---|
| ۱۰..... | نمودار ۱-۱- تعیین نرخ ارز واقعی تعادلی در بازار ارز..... |
| ۱۸..... | نمودار ۱-۱- روند تغییرات ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۱۳۵۷-۱۳۸۹ در ایران..... |
| ۶۴..... | نمودار ۴-۱- نوسانات نرخ واقعی ارز طی دوره زمانی ۸۹-۱۳۵۷. ماخذ: یافته‌های تحقیق..... |
| ۷۷..... | نمودار ۴-۲- نتایج حاصل از آزمون CUSUM برای الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی. ماخذ: یافته‌های تحقیق..... |
| ۷۸..... | نمودار ۴-۳- نتایج حاصل از آزمون CUSUMQ برای الگوی ارزش افزوده بخش کشاورزی. ماخذ: یافته‌های تحقیق..... |



۱-۱- مقدمه

از دیر باز کشاورزی نقش مهمی در اقتصاد کشورهای در حال توسعه، از جمله ایران داشته است. گرچه در فرآیند توسعه اقتصادی کشور از اهمیت نسبی این بخش کاسته شده است، اما هنوز سهم عمده‌ای از تولید ناخالص ملی، اشتغال، تجارت خارجی و رشد اقتصادی داشته و بخش بزرگی از نیازهای غذایی و ضروری جامعه را تامین می کند (شهام، ۱۳۸۱).

برای رسیدن به توسعه اقتصادی نیاز به رشد بخش خصوصی، بکارگیری سیاست‌های ارزی مناسب، ثبات نرخ ارز و رشد بخش‌های مختلف اقتصاد است. بی ثباتی و عدم اطمینان به تغییرات نرخ ارز و افزایش قیمت و عدم تخصیص مناسب منابع باعث شده است تا رشد قابل ملاحظه در بخش کشاورزی به چشم نیاید (عباسیان و همکاران، ۱۳۹۱). از این رو، با توجه به اهمیت بخش کشاورزی در اقتصاد ایران و تأثیرپذیری آن از سیاست‌های ارزی و بی ثباتی نرخ ارز، این تحقیق درصدد بررسی اثر نوسانات ناشی از نااطمینانی نرخ ارز بر ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۱۳۵۷-۱۳۸۹ در ایران می‌باشد.

۱-۲- تعریف مسأله

بخش کشاورزی در بین سایر بخش‌های اقتصادی کشور در زمینه تولید، اشتغال، امنیت غذایی، مبادلات خارجی، مزیت نسبی و حضور در صحنه‌های بین‌المللی از جایگاه ویژه‌ای برخوردار بوده و دارای نقش کلیدی در جریان توسعه اقتصادی است. کشاورزی ایران در دهه‌های اخیر رشد و توسعه چشم‌گیری داشته، ولی هنوز هم برخی از محصولات کشاورزی و فرآورده‌های آن وجود دارند که از طریق واردات تأمین می‌شوند. هرگونه سیاستی که در بخش کشاورزی اعمال و اجرا می‌شود، آثار متفاوتی خواهد داشت که مطالعه این آثار از جنبه‌های مختلف حائز اهمیت است (مهرابیان، ۱۳۸۰).

در ایران و دیگر کشورهای درحال توسعه، بخش کشاورزی به عنوان یکی از بخش‌های اصلی اقتصاد، تحت تأثیر سیاست‌های ارزی قرار گرفته، به طوری که ارزش‌گذاری نامناسب نرخ ارز و رقابت در بخش واردات و صادرات دست به دست یکدیگر داده و انگیزه تولید کشاورزی داخلی را در این کشورها از میان برده است. در ایران لزوم کاهش درآمدهای ارزی حاصل از نفت و حرکت به سمت بخش قابل ملاحظه‌ای از ارز مورد نیاز از طریق صادرات غیرنفتی روز به روز بیشتر احساس می‌شود. در این راستا، توجه به بخش کشاورزی به دلیل ارزش افزوده بالاتر و تولید محصولات کشاورزی به دلیل حداقل ارزبری در فرآیند تولید راهکار مناسبی برای رفع این مشکل می‌باشد (حسینی پور، ۱۳۸۱).

مشکل دیگری که به خصوص در طی سال‌های پس از انقلاب و دوران اجرایی برنامه‌های اول و دوم و سیاست‌های تعدیل و تثبیت به وضوح مشاهده شده است، وجود نوسانات ناشی از نااطمینانی در نرخ ارز می‌باشد. عامل مهم تأثیرگذار دیگر بر بخش‌های موجود در جامعه، روند تغییرات قیمت‌های نسبی است که در هر اقتصاد مبتنی بر بازار آزاد، تخصیص منابع بر اساس آن صورت می‌گیرد و در صورتی که قیمت‌های نسبی به طور مناسب تنظیم شده باشند، تخصیص منابع به صورت بهینه انجام می‌شود (ایزدی، ۱۳۸۷).

در بین متغیرهای کلان اقتصادی، نرخ ارز واقعی به عنوان نسبت قیمت کالاهای خارجی به کالاهای داخلی، تاثیر مهمی بر متغیرهای کلان اقتصادی دارد. تغییرات نرخ ارز واقعی به طور مستقیم بر روی تراز پرداخت‌ها اثر گذاشته و همچنین جهت تخصیص منابع را بین تولید کالاهای غیرتجاری و تجاری هدایت می‌کند. افزایش نرخ ارز واقعی باعث قوی‌تر شدن بخش خارجی اقتصاد و افزایش قدرت رقابت در بازارهای بین‌المللی می‌شود. لازم است نرخ ارز واقعی تعادلی را به گونه‌ای تعریف کرد تا در صورت تحقق آن، توازن در بعد داخلی و خارجی اقتصاد به صورت توأم

برقرار شود. انحراف از این نرخ تعادلی سبب تولید علائم اشتباه برای آحاد اقتصادی شده و اقتصاد را با هزینه‌های رفاهی مواجه می‌کند (حسینی، ۱۳۸۷).

۳-۱- اهمیت موضوع

سهم بخش کشاورزی در اشتغال، تولید ناخالص ملی، صادرات و همچنین تغییرات آن در جریان توسعه‌ی اقتصادی کشور منعکس‌کننده درجه وابستگی اقتصاد کشور به تولید محصولات و موقعیت کنونی بخش کشاورزی است. این بخش با وجود اعمال چندین دهه سیاست صنعتی و تقویت سایر بخش‌های اقتصادی و حتی اجرای سیاست بازدارنده توسعه، همچنان با قدرت به حیات خود ادامه داده و در شرایط نابهینه نیز شکوفایی و ظرفیت‌های نوینی را عرضه کرده است. به همین دلیل، در قوانین توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی جمهوری اسلامی ایران، از بخش کشاورزی به عنوان بخش استراتژیک و حیاتی یاد شده است (ساسولی و صالح، ۱۳۸۶).

هر کشوری به منظور دستیابی به اهداف اقتصادی خود، با توجه به وضعیت خاص اقتصادی، سیاسی و اجتماعی برنامه ویژه‌ای را در چارچوب سیاست‌های اقتصادی اتخاذ می‌کند. جملگی اقتصاددانان معتقدند که مهم‌ترین هدف‌های سیاست‌گذاری اقتصادی، حصول اشتغال کامل، تثبیت قیمت‌ها و رشد اقتصادی در جامعه می‌باشد. به همین منظور، امروزه در اغلب جوامع به ویژه در کشورهای در حال توسعه برای دستیابی به اهداف همه‌جانبه فوق از سیاست‌های ارزی^۱ استفاده می‌شود. این نوع سیاست‌ها از طریق ایجاد تغییرات در تقاضای کل، اثرات خود را به اقتصاد منتقل می‌کنند (قادری، ۱۳۸۳).

سیاست‌های ارزی به عنوان ابزاری قدرتمند در بین سیاست‌های کلان اقتصادی^۲ دولت‌ها، می‌توانند تأثیرات معنی‌داری بر متغیرهای مختلف اقتصادی داشته باشند. اهمیت بکارگیری این

1- Exchang rate policies

1- Macroeconomic Policies

سیاست‌ها از آنجایی که می‌توانند اقتصاد داخلی^۱ هر کشوری را با اقتصاد جهانی مرتبط سازند، بیش از پیش مشخص می‌شود. افزون بر آن، امروزه به وجود آمدن مسائلی همچون ادغام جهانی و جهانی‌شدن^۲ و گسترش مناسبات بین‌المللی سبب شده که استفاده از این نوع سیاست‌ها (سیاست‌های ارزی) توسط دولت‌ها بیشتر از گذشته مورد توجه قرارگیرد (حسینی پور، ۱۳۸۱).

باید توجه داشت که هدف اصلی بکارگیری سیاست‌های ارزی در زیربخش‌های کشاورزی، صنعت و تجارت نیل به اهداف اقتصاد ملی می‌باشد. در واقع، مقامات پولی به منظور دستیابی به اهداف اقتصاد ملی، با توجه به وضعیت و موقعیت اقتصاد کشور از سیاست‌های ارزی مناسب استفاده می‌کنند (گودرزی، ۱۳۸۳).

به طور کلی یکی از مهم‌ترین بحث‌ها و چالش‌های مطرح در اقتصاد کلان، اثر نوسانات ناشی از ناپایداری نرخ ارز بر متغیرهای کلان اقتصادی است. از آنجایی که نوسانات نرخ ارز در شرایط عدم اطمینان، عرضه و تقاضای محصولات کشاورزی را تحت تأثیر قرار می‌دهد، لذا بررسی اثرات آن بر تولید و قیمت محصولات کشاورزی حائز اهمیت بوده و می‌تواند توصیه‌های سیاستی مناسبی را برای مدیریت عرضه و تقاضای محصولات در این بخش ارائه نماید. در این راستا، نکته مهم و قابل توجه این است که نحوه و میزان تأثیرگذاری نوسانات نرخ ارز واقعی بر ارزش افزوده بخش کشاورزی، تا حد زیادی تحت تأثیر شرایط اولیه تولید در این بخش قرار دارد و به همین دلیل می‌تواند اثرات متفاوتی از خود بر جای بگذارد (Bhar and Mallik, 2010).

بر اساس مطالب بیان شده، سؤالات اصلی تحقیق حاضر به شرح ذیل می‌باشد:

۱- نوسانات ناشی از ناپایداری نرخ ارز چه تأثیری بر ارزش افزوده بخش کشاورزی دارد؟

2- World Economics

3-Globalization

۲- رابطه بین نرخ ارز واقعی و ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۱۳۵۷-۱۳۸۹ در ایران چگونه بوده است؟

۱-۴- اهداف

۱- بررسی وجود یا عدم وجود نوسان در نرخ ارز واقعی با بکارگیری روش‌های جدید اقتصادسنجی

۲- بررسی تأثیر نوسانات ناشی از ناطمینانی نرخ ارز واقعی بر روی ارزش افزوده بخش کشاورزی

۳- بررسی ارتباط بین متغیرهای بخش کشاورزی با استفاده از مدل‌های جدید همگرایی و الگوی خود رگرسیونی با وقفه‌های توزیعی گسترده (ARDL)

۱-۵- فرضیات

۱- ناطمینانی ناشی از نوسانات نرخ ارز سبب کاهش ارزش افزوده بخش کشاورزی می‌شود.
 ۲- بین نرخ ارز واقعی و ارزش افزوده بخش کشاورزی طی دوره ۱۳۵۷-۱۳۸۹ در ایران رابطه مثبت و معنی‌داری وجود دارد.

۱-۶- جایگاه بخش کشاورزی در اقتصاد ملی

بخش کشاورزی در اقتصاد ایران از اهمیت ویژه‌ای برخوردار است. این بخش یکی از تواناترین بخش‌های اقتصادی کشور است که تأمین‌کننده بیش از یک پنجم تولید ناخالص داخلی، بیش از یک پنجم اشتغال، بیش از یک چهارم صادرات غیرنفتی و بیش از چهار پنجم نیازهای غذایی کشور در دهه اخیر می‌باشد. توسعه بخش کشاورزی، پیش شرط و نیاز ضروری توسعه اقتصادی کشور است و تا زمانی که موانع توسعه در این بخش برطرف نشود سایر بخش‌ها به شکوفایی، رشد و توسعه دست نخواهند یافت.

۱-۷- مبانی نظری و تعریف مفاهیم اصلی تحقیق

۱-۷-۱- مفهوم نرخ ارز

همه کشورها دارای پول ملی مخصوص به خود می‌باشند که در انجام معاملات داخلی مورد استفاده مردم آن کشور قرار می‌گیرد. اما، زمانی که مردم یک کشور بخواهند خدمات و کالای کشور دیگری را خریداری کرده و یا به دیگر کشورها کالا و خدمات بفروشند، نیاز است که به واحد پول مشترکی برسند و واحد پول خود را به واحد پول کشور دیگر تبدیل نمایند. این تبدیل به وسیله نرخ به نام نرخ ارز صورت می‌گیرد. عوامل متعددی وجود دارند که قدرت پول ملی کشور در مقایسه با ارزش پول سایر کشورها را تحت‌الشعاع قرار داده و در تعیین نرخ ارز مؤثر هستند. از مهم‌ترین این عوامل می‌توان به وضعیت و قدرت تولید اقتصادی هر کشور اشاره کرد (رحیمی بروجردی، ۱۳۷۶).

۱-۷-۲- نرخ ارز اسمی^۱ و واقعی^۲

نرخ اسمی ارز، ارزش پول خارجی بر پایه پول رایج کشور می‌باشد. این نرخ ارزش پول داخلی را بر حسب اسعار خارجی (ارزش پول خارجی) در زمان فعلی یا کنونی نشان می‌دهد. این نرخ همواره شاخص مناسبی برای محاسبه‌ی مقدار پرداختی‌ها و دریافتی‌ها در معاملات خارجی برای واردکنندگان و صادرکنندگان نمی‌باشد. بسیاری از کشورها با نظام ارزی ثابت، معمولاً ارزش پول خود را ثابت نگه داشته و به هنگام عدم توازن خارجی، به جای تغییر معاملات پول داخلی، به وضع مالیات بر واردات و صادرات، اخذ پیمان ارزی، مالیات اضافی بر معاملات ارزی، تسهیلات و امتیازات برای صادرات، نرخ‌های ترجیحی برای صادرات و محدودیت‌ها و کنترل‌های دیگر واردات، از جمله سپردن وثیقه و هر عامل دیگری که برای به دست آوردن ارز از طریق فروش کالا و خدمات در خارج از کشور می‌پردازند. این اقدامات سبب می‌شود نرخ ارزی که به وسیله آن،

1-Nominal Exchange Rate

2- Real Exchange Rate

دریافتی‌ها و پرداختی‌ها در معاملات انجام می‌گیرد، با نرخ ارز اسمی یا رسمی متفاوت باشد. بر این اساس، نرخ مبادله بین هر دو پول، به عنوان یک نرخ دو طرفه در مفاهیم جدید مطرح می‌شود که نشان‌دهنده هزینه‌های مبادله‌ی پول در بازار ارز، نرخ مؤثر ارز و متوسط نرخ‌های ارز دو طرفه می‌باشد (Peree and Steinherr, 1989).

نرخ واقعی یا حقیقی ارز، نسبت قیمت نسبی داخلی کالاهای قابل مبادله به قیمت نسبی داخلی کالاهای غیرقابل مبادله می‌باشد. در واقع، نرخ واقعی ارز بیانگر چگونگی تخصیص منابع بین بخش‌های قابل مبادله و غیرقابل مبادله است. بر این اساس، افزایش در نرخ واقعی ارز، تولید کالاهای قابل مبادله را به طور نسبی سودآور می‌کند و این امر به انتقال منابع از بخش غیرقابل مبادله به بخش قابل مبادله می‌انجامد. اصولاً نرخ واقعی ارز، تعیین‌کننده‌ی وضعیت اقتصادی هر کشور در دو صحنه داخلی و خارجی است. بهبود در این نرخ موجب بهبود موقعیت اقتصادی کشور در صحنه داخلی و رقابت بین‌المللی خواهد شد. همچنین، اختلاف در نرخ واقعی ارز به بدتر شدن توان رقابت کشور در عرصه بین‌المللی خواهد انجامید (Edwards, 1986).

۳-۷-۱- اصول و معیارهای تعیین نرخ ارز

در اصول تئوری، سیاست نرخ ارز می‌تواند به صورت کاهش ارزش پول ملی نسبت به ارزش پول خارجی باشد که این سیاست در نظام‌های ارزی ثابت^۱ و شناور^۲، ارزان شدن نرخ ارز نامیده می‌شود. همچنین، سیاست نرخ ارز می‌تواند به صورت افزایش ارزش پول ملی نسبت به ارزش پول خارجی باشد که این سیاست در نظام‌های ارزی ثابت و شناور، گران شدن نرخ ارز نامیده می‌شود (موسی‌نژاد، ۱۳۷۵). اصولاً تعیین نرخ ارز براساس مفهوم بلندمدت آن، یعنی نرخ واقعی ارز صورت می‌گیرد. برای تعیین نرخ واقعی ارز معیارهای مختلفی معرفی شده است که در اینجا به سه مورد اشاره می‌شود:

1- Devaluation
2- Depreciation

الف- تئوری قدرت برابری خرید^۱:

ب- تئوری عرضه و تقاضای اوراق بهادار

ج- نسبت بین قدرت دلاری دستمزد یا هزینه‌های دلاری تولید در داخل و خارج یک کشور
تئوری قدرت برابری خرید می‌تواند به صورت نسبی و یا مطلق بیان گردد. این تئوری در تعیین نرخ واقعی ارزش بیش از دو تئوری دیگر حائز اهمیت می‌باشد و بیان می‌کند که نرخ ارزش خارجی از نسبت قدرت خرید واقعی پول دو کشور به دست می‌آید. براساس این تئوری، سطح قیمت‌ها در دو کشور به عنوان متغیرهای مستقل و نرخ‌های واقعی ارزش در دو کشور به عنوان متغیرهای وابسته یا تابع شناخته می‌شوند (Hall et al., 2010).

تعاریف متعددی از تئوری قدرت برابری خرید (PPP) صورت گرفته است. کوند (۱۹۹۸) این تئوری را یک موضوع ساده می‌داند و معتقد است که تئوری قدرت برابری خرید مادامی تحقق می‌یابد که براساس آن، سطوح قیمت‌های ملی در حالت پول مشترک با سطوح قیمت‌های خارجی به تعادل برسند. فرنکل (۱۹۸۱) و ویلسامسون (۱۹۸۳) براساس مفهوم تئوری قدرت برابری خرید بیان می‌دارند که کشورهایی که درآمد سرانه بهتر و بالاتری دارند، دارای پول رایج یا نرخ ارزش قوی‌تری نیز می‌باشند. آن‌ها معتقدند که تئوری قدرت برابری خرید دارای یک اشکال اساسی بوده و عاجز از بیان چگونگی به وقوع پیوستن تغییرات نرخ ارزش واقعی می‌باشد. به عنوان مثال، روشن نیست که چه وقت افزایش نرخ ارزش داخلی به معنی فاصله گرفتن از تعادل و چه وقت بیان‌کننده گرایش به تعادل جدید است.

۴-۷-۱- چگونگی تعیین نرخ ارزش واقعی تعادلی

اگر مانند هر کالایی، برای پول نیز بازاری در نظر گرفته شود و هیچ‌گونه فشار و اعمال محدودیت خارجی بر آن وجود نداشته باشد، در این صورت برای پول خارجی مزبور تقاضا و عرضه‌ای وجود

خواهد داشت که قیمت پول مذکور از تلاقی این عرضه و تقاضا به دست خواهد آمد. به مثابه سایر کالاها در شرایط عادی، منحنی تقاضا برای ارز خارجی نزولی بوده، در حالی که منحنی عرضه ارز خارجی صعودی و دارای شیب مثبت می‌باشد، چرا که در این حالت تقاضا برای ارز خارجی صرفاً جهت تهیه کالاها و خدمات خارجی است. در صورت استفاده از تعریف نرخ ارز مستقیم، هر چه قدر که نرخ ارز بالاتر باشد به این مفهوم است که قیمت کالاهای خارجی گران‌تر بوده و در این صورت تقاضای کمتری برای کالای مزبور و در نتیجه تقاضای کمتری برای ارز خارجی وجود خواهد داشت. بنابراین، با بالارفتن نرخ ارز، تقاضای ارز کمتر شده و در نتیجه رابطه معکوسی بین این دو وجود خواهد داشت. در نقطه مقابل، عرضه ارز خارجی به منظور خرید کالا و خدمات از کشور خودی است که در این حالت با بالارفتن نرخ ارز، کالاهای داخلی خود را ارزان‌تر نمایان خواهند ساخت. بنابراین تقاضای بیشتری از کالاهای داخلی صورت گرفته و عرضه ارز خارجی افزایش خواهد یافت. در نتیجه با بالارفتن نرخ ارز، عرضه ارز بیشتر شده که در این حالت یک رابطه مستقیم بین نرخ ارز و عرضه ارز وجود خواهد داشت. به طور کلی، در هر دو حالت فوق با برخورد عرضه و تقاضای ارز در بازار ارز، نرخ ارزی واقعی تعادلی در نقطه برخورد یا نقطه تعادل به دست خواهد آمد (حسینی‌پور، ۱۳۸۱). شکل ۱-۱ این موضوع را به صورت هندسی نشان می‌دهد:

نمودار ۱-۱ تعیین نرخ ارز واقعی تعادلی در بازار ارز

