



دانشگاه شیراز

دانشکده کشاورزی

گروه اقتصاد کشاورزی

پایان نامه

برای دریافت درجه کارشناسی ارشد در رشته اقتصاد کشاورزی

عنوان

# بررسی عوامل مؤثر بر روی قیمت صادراتی محصولات خشکبار ایران (مطالعه موردی: کشمش)

استاد راهنما

دکتر جعفر حقیقت

استادان مشاور

دکتر قادر دشتی

دکتر حسین راحلی

پژوهشگر

رسول حسین پور

مهرماه ۱۳۸۷

نام خانوادگی دانشجو: حسین پور	نام: رسول
عنوان پایان نامه: بررسی عوامل مؤثر بر روی قیمت صادراتی محصولات خشکبار ایران (مطالعه موردی: کشمش)	
استاد راهنما: دکتر جعفر حقیقت	
استادان مشاور: دکتر حسین راحلی - دکتر قادر دشتی	
مقطع تحصیلی: کارشناسی ارشد	رشته: مهندسی کشاورزی
گرایش: اقتصاد کشاورزی	تعداد صفحه: ۹۰
دانشگاه: دانشگاه تبریز	دانشکده: کشاورزی
تاریخ فارغ التحصیلی: ۱۳۸۷/۷/۲۱	تاریخ فارغ التحصیلی: ۱۳۸۷/۷/۲۱
کلید واژه ها: روش جوهانسن - جوسیلیوس، رهیافت ARDL، قیمت صادراتی کشمش، صادرات ایران، صادرات ترکیه و ایالات متحده، نرخ واقعی ارز	
<p><b>چکیده:</b> صادرات محصولات کشاورزی به لحاظ ارز آوری و کم کردن وابستگی کشور به درآمدهای حاصل از فروش نفت خام دارای اهمیت می باشد. از بین محصولات کشاورزی، محصولات خشکبار بخش اعظمی از صادرات این بخش را به خود اختصاص داده است. بنابراین، مطالعه عوامل تأثیرگذار روی صادرات این بخش می تواند اهمیت قابل ملاحظه ای داشته باشد. به دلیل مطالعات صورت گرفته روی عوامل مؤثر بر صادرات پسته و خرما، این مطالعه روی عوامل تأثیرگذار روی قیمت صادراتی کشمش تمرکز کرده است. این تحقیق از نوع توصیفی، با نگرش کاربردی بوده و روش جمع آوری اطلاعات، اسنادی و کتابخانه ای می باشد. از مدل های ARDL و روش جوهانسن - جوسیلیوس برای تجزیه و تحلیل داده ها با استفاده از نرم افزار Microfit4 استفاده گردیده است. آمار و اطلاعات مورد استفاده در این تحقیق از داده های آماری سازمان خواروبار کشاورزی ملل متحد (FAO)، سری های زمانی موجود در بانک مرکزی ج.ا.ا، و اطلاعات موجود در سی دی IFS استخراج گردیده است. دوره مطالعه تحقیق حاضر سری زمانی سالهای ۸۴-۱۳۵۰ می باشد. نتایج نشان داد که نرخ واقعی ارز قیمت کشمش صادراتی را در جهت مثبت تغییر می دهد. متغیر مقدار صادرات ایران و متغیر مقدار صادرات ترکیه و ایالات متحده، قیمت صادراتی را بصورت منفی تحت تأثیر قرار می دهند. متغیرهای مجازی انقلاب اسلامی ایران و دوره هشت ساله جنگ تحمیلی، بصورت مثبت قیمت صادراتی کشمش را تحت تأثیر قرار داده اند. بر اساس نتایج مطالعه پیشنهاد می گردد که سیاست های پولی بانک مرکزی ج.ا.ا به گونه ای طراحی گردد که از نوسانات نرخ ارز بصورت غیرقابل پیش بینی جلوگیری شود. ترخیص کشمش صادراتی از گمرک های کشور در زمان اندک صورت پذیرد و کشمش تقاضا شده در بازار جهانی بدون تأخیر در زمان درخواست شده در اختیار مصرف کننده خارجی قرار گیرد. دولت در جهت حمایت از صادرکنندگان کشمش می تواند مابه التفاوت بین قیمت صادراتی ایران و کشورهای رقیب را به صادرکنندگان پرداخت نموده و آنها را به افزایش صادرات تشویق نماید.</p>	

## فصل اول: کلیات

۱	۱-۱- مقدمه
۲	۲-۱- بیان مسأله
۳	۳-۱- ضرورت و اهمیت تحقیق
۴	۴-۱- اطلاعات توصیفی در ارتباط باکشمش
۷	۵-۱- اهداف تحقیق
۸	۶-۱- سئوالات تحقیق
۸	۷-۱- ساختار پایان نامه

## فصل دوم: پایه‌های نظری و پیشینه پژوهش

۱۰	۱-۲- مقدمه
۱۰	۲-۲- مبانی نظری
۱۰	۱-۲-۲- تابع عرضه صادرات
۱۱	۲-۲-۲- رابطه انتقالی نرخ ارز
۱۳	۳-۲- پیشینه تحقیق
۱۳	۱-۳-۲- مطالعات خارجی
۱۴	۲-۳-۲- مطالعات داخلی
۱۶	۳-۳-۲- جمع‌بندی

## فصل سوم: مبانی و روش‌ها

۱۸	۱-۳- مقدمه
۱۸	۲-۳- پایایی
۱۸	۳-۳- آزمون ریشه واحد برای پایایی
۱۹	۱-۳-۳- آزمون ریشه واحد دیکی- فولر و دیکی- فولر تعمیم یافته
۲۰	۲-۳-۳- آزمون ریشه واحد فیلیپس و پرون
۲۳	۴-۳- همجمعی
۲۴	۱-۴-۳- الگوی خودتوضیح با وقفه‌های گسترده (ARDL)
۲۶	۵-۳- الگوی تصحیح خطا (ECM)
۲۷	۶-۳- الگوی خودتوضیح برداری (VAR)

۲۸	۳-۷- الگوی تصحیح خطای برداری (VECM)
۲۸	۳-۸- روش همجمعی جوهانسن - جوسیلیوس
۲۹	۳-۸-۱- تعیین بردارهای همجمعی
۳۲	۳-۸-۲- آزمون برونزایی ضعیف
۳۲	۳-۸-۳- توابع عکس‌العمل آنی (تکانه‌ها)
۳۲	۳-۸-۴- تجزیه واریانس
۳۲	۳-۹- معرفی مدل و متغیرهای مطالعه
۳۵	۳-۱۰- تعریف متغیرهای تحقیق
۳۵	۳-۱۰-۱- نرخ ارز واقعی
۳۶	۳-۱۰-۲- شاخص قیمت صادراتی
۳۶	۳-۱۰-۳- مقدار صادرات ایران و مقدار صادرات ترکیه و ایالات متحده
۳۷	۳-۱۰-۴- متغیر مجازی انقلاب اسلامی ایران
۳۷	۳-۱۰-۵- متغیر مجازی جنگ تحمیلی
۳۷	۳-۱۱- آمار و اطلاعات مورد استفاده

#### فصل چهارم: نتایج و بحث

۳۹	۴-۱- مقدمه
۳۹	۴-۲- بررسی پایایی متغیرهای مدل
۴۲	۴-۳- نتایج حاصل از روش خودتوضیح با وقفه‌های توزیعی
۴۵	۴-۴- آزمون‌های تشخیص
۴۵	۴-۵- آزمون پایداری ضرایب
۴۶	۴-۶- نتایج حاصل از آزمون همجمعی جوهانسن - جوسیلیوس
۴۶	۴-۶-۱- تعیین بردارهای همجمعی و استخراج روابط بلندمدت
۴۸	۴-۶-۲- آزمون برونزایی ضعیف
۵۰	۴-۶-۳- توابع عکس‌العمل آنی (تکانه‌ها)

۵۱

۴-۶-۴- تجزیه واریانس

### فصل پنجم: نتیجه گیری و پیشنهادها

۵۴

۱-۵- خلاصه و نتیجه گیری

۵۶

۲-۵- پیشنهادها

۵۷

۳-۵- پیشنهادها برای مطالعات آتی

### منابع مورد استفاده

۵۹

منابع فارسی

۶۰

منابع انگلیسی

### ضمائم

۶۳

خروجی های نرم افزار Microfit4

۸۲

نمودارهای توصیفی

۹۰

چکیده انگلیسی

## فهرست جداول

صفحه	عنوان
۲	جدول (۱-۱): وزن و ارزش صادرات کل ایران، بخش کشاورزی و بخش خشکبار در سال ۱۳۸۶
۳۹	جدول (۱-۴): نتایج آزمون دیکی - فولر برای متغیر مقدار صادرات کشمش
۴۰	جدول (۲-۴): نتایج آزمون دیکی - فولر برای متغیر مقدار صادرات کشورهای رقیب
۴۰	جدول (۳-۴): نتایج آزمون دیکی - فولر برای متغیر نرخ واقعی ارز
۴۰	جدول (۴-۴): نتایج آزمون دیکی - فولر برای متغیر شاخص قیمت صادراتی
۴۱	جدول (۵-۴): نتایج آزمون DF و ADF برای بررسی پایایی متغیرهای مدل
۴۲	جدول (۶-۴): نتایج حاصل از برآورد تابع شاخص قیمت صادراتی کشمش با روش $ARDL(1,1,1,0)$
۴۴	جدول (۷-۴): نتایج حاصل از برآورد الگوی تصحیح خطا
۴۷	جدول (۸-۴): نتایج آزمون همجمعی جوهانسن - جوسیلیوس (عرض از مبدأ نامقید و روند مقید)
۴۹	
۵۱	جدول (۹-۴): نتایج آزمون برونزایی ضعیف بر روی متغیرهای توضیحی
۵۱	جدول (۱۰-۴): نتایج عکس‌العمل آنی مدل به وقوع شوک
	جدول (۱۱-۴): نتایج حاصل از تجزیه واریانس

## فهرست نمودارها

صفحه	عنوان
۴	نمودار ۱-۱: میزان تولید محصول کشمش برای تولیدکنندگان عمده
۵	نمودار ۱-۲: تولیدکنندگان عمده کشمش در جهان
۵	نمودار ۱-۳: میزان صادرات کشمش صادرکنندگان عمده جهان
۶	نمودار ۱-۴: ارزش صادراتی کشمش ایران در ایران
۶	نمودار ۱-۵: ارزش هر واحد صادراتی کشمش ایران
۷	نمودار ۱-۶: سهم سه کشور ترکیه، ایالات متحده و ایران از بازار جهانی کشمش
۳۳	نمودار ۱-۳: سهم صادرکنندگان عمده کشمش از بازار جهانی
۴۳	نمودار ۱-۴: روند متغیر لگاریتم شاخص قیمت صادراتی
۴۵	نمودار ۱-۲: آزمون پایداری ضرایب (CUSUM)
۴۶	نمودار ۱-۳: آزمون پایداری ضرایب (CUSUMQ)

## ۱-۱- مقدمه

تجارت محصولات کشاورزی در سطح جهان از جهات مختلفی دارای اهمیت می باشد. قبل از انقلاب صنعتی، سهم کالاهای کشاورزی در کل کالاهای قابل مبادله بسیار بود. اما با وقوع انقلاب صنعتی و ظهور دستاوردهای آن، نسبت کالاهای مصنوع به محصولات کشاورزی در جهان افزایش یافت. با وجود کاهش سهم بخش کشاورزی در تجارت جهانی، به دلیل نقش استراتژیک این بخش در امنیت غذایی، تجارت آن بسیار حائز اهمیت است. از طرف دیگر، در بسیاری از کشورهای در حال توسعه، سهم عمده فعالیت‌های اقتصادی در بخش کشاورزی متمرکز شده است. بنابراین اقتصاد این کشورها اتکای بسیاری به این بخش دارد و به همین جهت صدور محصولات کشاورزی منشأ مهم تزریق ارز خارجی به بدنه اقتصادی این کشورها به شمار می‌رود. همچنین، سطح گسترده ارتباطات پسین و پیشین تولید محصولات کشاورزی باعث می شود که تولید و مبادله این محصولات به عاملی در جهت رشد فعالیت‌های وابسته، اعم از صنعتی و خدماتی تبدیل شود.

در حال حاضر، بسیاری از کشورهای در حال توسعه از جمله ایران، به شدت متکی به درآمد حاصل از صادرات مواد اولیه نظیر نفت خام هستند. پس در ایران، برای برونرفت از اقتصاد تک‌محصولی وابسته به درآمدهای حاصل از صدور نفت خام، با عنایت به وجود توانایی‌های مناسب تولید کالاهای غیر نفتی بویژه در بخش کشاورزی، زمینه افزایش درآمدهای ارزی از طریق گسترش صادرات در این بخش وجود دارد (محمودزاده و زیبایی، ۱۳۸۳).

با توجه به مطالب بالا، می توان گفت لزوم توجه به مقوله صادرات غیرنفتی به طور عام و صادرات محصولات کشاورزی بطور خاص قابل انکار نیست. در بین محصولات صادراتی کشاورزی، صادرات محصولات خشکبار بخش عمده‌ای را به خود اختصاص داده‌اند. برای اطلاع از این امر می توان به جدول ۱، مراجعه کرد.



جدول (۱-۱): وزن و ارزش صادرات کل، بخش کشاورزی و خشکبار ایران در سال ۱۳۸۶

صادرات	وزن	درصد از بخش بزرگتر	ارزش	درصد از بخش بزرگتر	ارزش	درصد از بخش بزرگتر
کل	۳۱	-	۱۵	-	۱۳۹	-
کشاورزی	۳	۱۰	۲/۶	۱۷	۲۴	۱۷
خشکبار	۰/۴۸۴	۱۶	۱/۵	۵۷/۶	۱۴	۵۸

واحدها(وزن:میلیون تن ، ارزش دلاری: میلیارد، ارزش ریالی: هزارمیلیارد)

منبع: سالنامه آماری بازرگانی خارجی جمهوری اسلامی ایران، معاونت طرح و برنامه گمرک جمهوری اسلامی ایران، دفتر آمار و خدمات ماشینی، سال ۱۳۸۶.

از محصولات خشکبار به ترتیب، پسته، خرما و کشمش از عمده ترین محصولات صادراتی ایران هستند<sup>۱</sup>. با توجه به اینکه در ارتباط با دو محصول پسته و خرما مطالعات و تحقیقات زیادی صورت گرفته و کمتر محصول کشمش مورد توجه قرار گرفته است، تحقیق حاضر بر روی محصول کشمش تمرکز نموده و عوامل مؤثر بر قیمت صادراتی محصول کشمش را مورد بررسی قرار خواهد داد.

## ۱-۲- بیان مسأله

از مهم ترین اقدامات در زمینه کاهش وابستگی کشور به درآمد نفت، افزایش صادرات غیر نفتی است. ایجاد زمینه‌های جدید و افزایش سطح اشتغال در بخش‌های مختلف اقتصاد، بهبود کیفیت تولیدات و قابلیت رقابتی کردن آنها و استفاده از ظرفیت‌های خالی تولید از عواملی هستند که ضرورت توجه به توسعه صادرات غیر نفتی را مهم می‌سازند. جهش صادرات غیر نفتی در برنامه‌های پنجساله توسعه اقتصادی - اجتماعی و فرهنگی جزء اهداف اصلی است که تنها با بهره‌گیری از تمامی مزیت‌های نسبی و قابل خلق در بخش‌های مختلف اقتصادی، تلاش و برنامه‌ریزی برای حفظ بازارهای صادراتی و نفوذ در بازارهای هدف، قابل دستیابی خواهد بود (تاجیانی و کوپاهی، ۱۳۸۴). بخش کشاورزی یکی از بخش‌های اقتصادی است که میزان بالایی از اشتغال و سطح اندکی از سرمایه گذاری را نسبت به بخش های دیگر بکار می‌گیرد. کشور ایران، در زمینه تولید محصولات مختلف کشاورزی به لحاظ آب و هوایی دارای موقعیت مناسبی می‌باشد، که

<sup>۱</sup> و<sup>۲</sup> سالنامه آماری سازمان خواربار و کشاورزی (FAO)، سالهای ۲۰۰۶-۱۹۶۱.

زمینه را برای تولید محصولات مختلف فراهم آورده است. در این بین کشور ایران از عمده ترین تولیدکنندگان و صادرکنندگان خشکبار در جهان به شمار می‌رود. پسته، خرما و کشمش از جمله مهم ترین اقلام صادراتی ایران می‌باشند<sup>۳</sup>. در بازار جهانی این محصولات، ایران دارای جایگاه مناسبی هستند ولی آنچه جای تأمل دارد افزایش سهم کشورهای رقیب ایران در بازار جهانی است. در ارتباط با محصول کشمش، ایران بعد از ایالات متحده و ترکیه در رتبه سوم تولید<sup>۳</sup> و بعد از ترکیه در رتبه دوم صادرات کشمش قرار دارد<sup>۴</sup>. با کمترین افزایش قیمت کشمش صادراتی ایران در بازار جهانی و یا کاهش کیفیت محصول کشمش صادر شده، امکان از دست دادن سهم از بازار جهانی این محصول وجود دارد. بنابراین، مسئله موجود در این ارتباط مواردی است که قابلیت اثرگذاری روی قیمت صادراتی را دارا می‌باشند.

### ۳-۱- ضرورت و اهمیت تحقیق

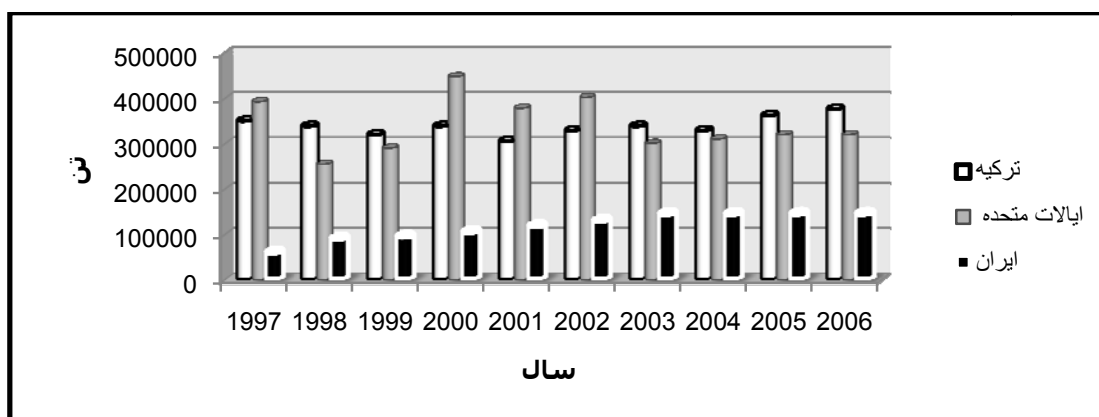
جهت‌گیری سیاست‌های اقتصادی دولت در سالهای اخیر عدم اتکای کشور صرفاً به درآمدهای حاصل از صادرات نفت خام، و گرایش به سمت توسعه و گسترش صادرات غیر نفتی بوده است. از آنجایی که، سهم قابل توجهی از درآمدهای ارزی حاصل از صادرات غیر نفتی کشور (به غیر از محصولات پتروشیمی و میعانات گازی) مربوط به صادرات محصولات خشکبار است. پس تمرکز روی قیمت محصول کشمش صادراتی در بازار جهانی نقش قابل ملاحظه‌ای در درجه رقابت پذیری محصول مورد نظر خواهد داشت. برای تلاش در جهت بالا بردن میزان رقابت پذیری کشمش صادراتی کشور بررسی عوامل تأثیر گذار روی قیمت صادراتی آن و پی‌بردن به درجه تأثیرپذیری از جانب هر کدام می‌تواند کاربردهای مفیدی برای سیاست‌گذاران و تولیدکنندگان و صادر کنندگان محصول کشمش داشته باشد.

<sup>۳</sup> سالنامه آماری سازمان خواربار و کشاورزی (FAO)، سالهای ۲۰۰۶-۱۹۹۷.

<sup>۴</sup> سالنامه آماری سازمان خواربار و کشاورزی (FAO)، سالهای ۲۰۰۵-۱۹۹۶.

### ۱-۴- اطلاعات توصیفی در ارتباط با کشمش

بر اساس سالنامه های آماری بازرگانی خارجی گمرک جمهوری اسلامی ایران، در سال ۱۳۸۶، حدود ۱۵۹ هزار تن<sup>۵</sup> محصول کشمش به ارزش ۱۶۱ میلیون دلار (معادل ۱۴۹۷ میلیارد ریال) عمدتاً به کشورهای آلمان، اوکراین، امارات متحده عربی، روسیه، لهستان، پاکستان، اتریش، انگلستان، کانادا، رومانی، عراق، مجارستان، هلند، فیلیپین، جمهوری آذربایجان، الجزایر و مراکش صادر گردیده است.<sup>۶</sup> روند تولید کشمش در دوره ده ساله اخیر مطابق نمودار ۱-۱ بیان می دارد که ایالات متحده، ترکیه و ایران سه تولید کننده عمده محصول کشمش در جهان می باشند. همچنین، ملاحظه می گردد که روند تقریباً افزایشی در تولید کشمش در طی این دوره در ایران وجود دارد.

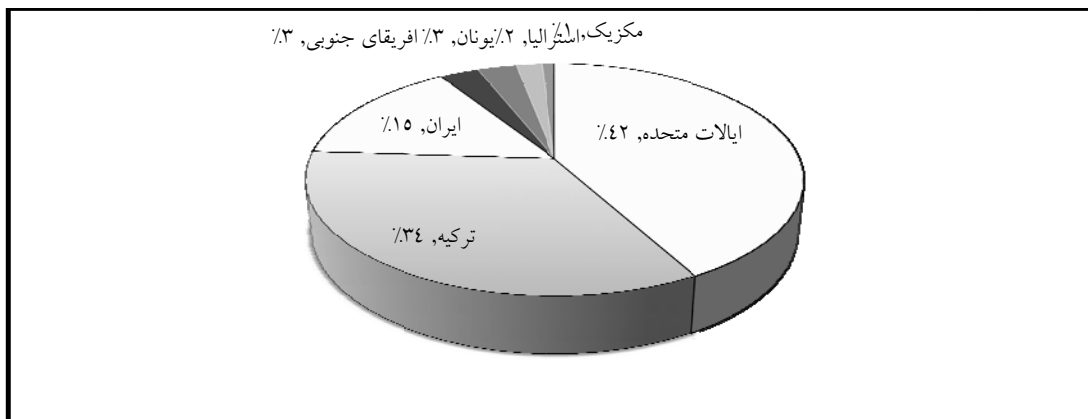


نمودار ۱-۱: میزان تولید محصول کشمش برای تولید کنندگان عمده در دوره ۲۰۰۶-۱۹۹۷. منبع: FAO.

همچنین در نمودار ۱-۲ سهم کشورهای تولیدکننده کشمش را از کل تولید جهانی کشمش مشاهده می کنید.

<sup>۵</sup> سالنامه آماری سازمان خواربار و کشاورزی (FAO)، سالهای ۲۰۰۶.

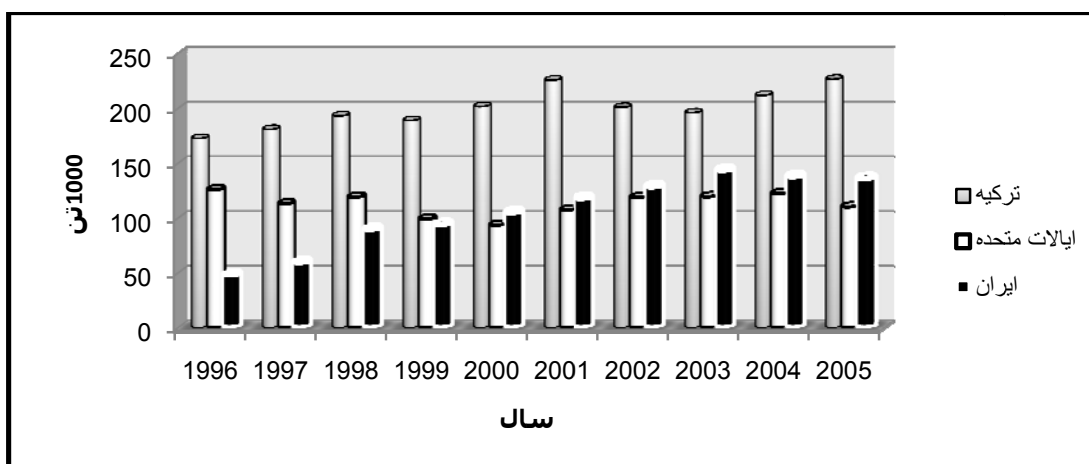
<sup>۶</sup> سالنامه آماری بازرگانی خارجی جمهوری اسلامی ایران، معاونت طرح و برنامه گمرک جمهوری اسلامی ایران- دفتر آمار و خدمات ماشینی، سال ۱۳۸۶.



نمودار ۱-۲: تولیدکنندگان عمده کشمش در جهان (درصد). منبع: سایت صادرکنندگان خشکبار<sup>۷</sup>

همان طوری که نمودار ۱-۲ نشان می‌دهد، ایران در جمع سه کشور عمده تولید کننده کشمش در جهان قرار دارد و سهم ایران بیش از مجموع سهم چهار کشور آفریقای جنوبی، یونان، استرالیا و مکزیک می‌باشد.

بعلاوه، روند صادرات کشمش برای کشورهای عمده صادر کننده در دوره ده ساله اخیر بصورت نمودار ۱-۳ می‌باشد.



نمودار ۱-۳: میزان صادرات کشمش صادر کنندگان عمده جهان. منبع: FAO.

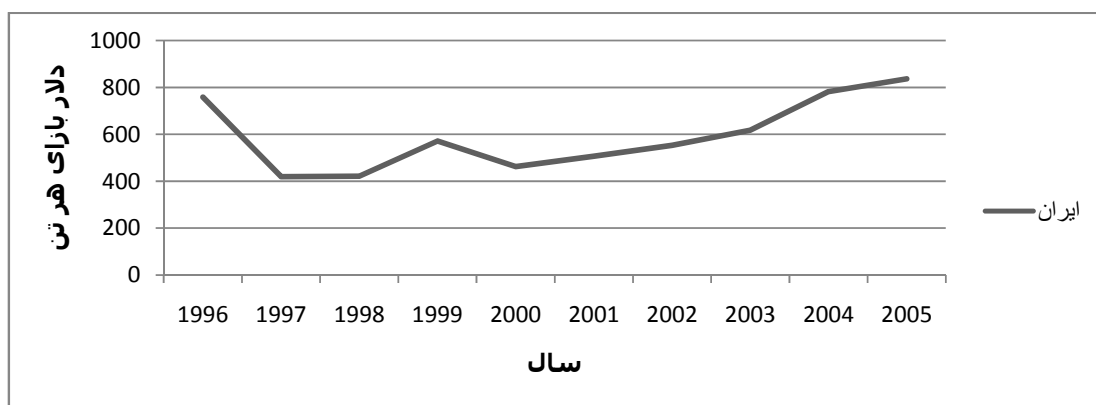
در نمودار ۱-۳، روند صادرات کشمش ایران روند صعودی داشته و در میانه دوره از میزان صادرات ایالات متحده بیشتر گردیده است که نشان دهنده بالا رفتن سهم ایران از بازار جهانی است. در نمودار ۱-۴، روند ارزش صادرات کشمش را در طی دوره ۱۳۸۵-۱۳۸۰ ملاحظه می‌شود:

<sup>7</sup> [www.driedfruitexporters.com](http://www.driedfruitexporters.com)



نمودار ۱-۴: روند ارزش صادرات کشمش در ایران. منبع: گمرک جمهوری اسلامی ایران.

در نمودار ۱-۴، روند تقریباً صعودی ارزش صادرات کشمش می‌تواند بیانگر این باشد که میزان صادرات و یا قیمت صادراتی در این دوره روند افزایشی داشته‌اند. با توجه به نمودار ۱-۵، که روند صعودی قیمت صادراتی در طی دوره ۲۰۰۱-۲۰۰۵ نشان می‌دهد و نیز روند صعودی میزان صادرات در نمودار ۱-۳، تا سال ۲۰۰۳ هر دو عامل میزان صادرات و قیمت صادراتی عامل افزایش ارزش صادراتی بوده‌اند. به دلیل اینکه از سال ۲۰۰۳ به بعد میزان صادرات اندکی روند کاهشی داشته، افزایش ارزش صادراتی از سال ۲۰۰۳ به بعد ناشی از افزایش در قیمت صادراتی بوده است. همچنین، برای پی بردن به روند قیمت صادراتی کشمش در ایران، می‌توان به نمودار ۱-۵ مراجعه نمود.

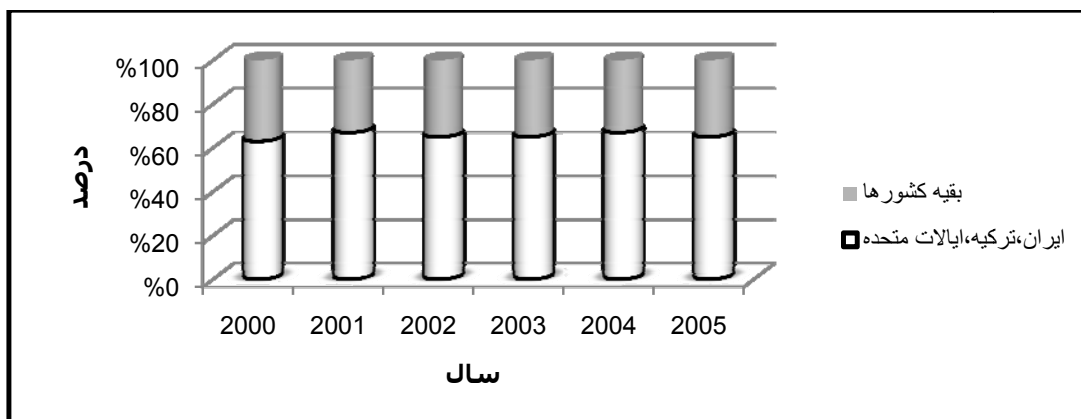


نمودار ۱-۵: ارزش هر واحد صادراتی کشمش ایران. منبع: FAO.

با روند نزولی ارزش هر واحد صادراتی کشمش در ابتدا صادرات کشمش بصورت فزاینده بالا رفته و در مواردی که افزایش قیمت داشته‌ایم روند صعودی افزایش صادرات کندتر شده است.

افزایش یافته است. دلیل است که به کاهش یا افزایش عرضه آن در بازار جهانی، افزایش یا کاهش تقاضای جهانی در اثر عوامل طبیعی، تغییر عادات مصرفی مصرف‌کنندگان و ... اشاره کرد.

برای نشان دادن سهم بازاری سه کشور عمده تولیدکننده و صادر کننده کشمش نمودار ۱-۶ را ملاحظه می‌کنید:



نمودار ۱-۶: سهم سه کشور ایران، ترکیه و ایالات متحده از بازار جهانی کشمش. منبع: FAO.

با عنایت به نمودار (۱-۶) می‌توان پی برد که بازار جهانی محصول کشمش بصورت غیررقابتی بوده و کشورهایی که سهم عمده‌ای از بازار جهانی کشمش را به خود اختصاص داده‌اند، توانایی در تعیین قیمت صادراتی را دارند. البته برای تعیین ساختار دقیق بازار جهانی کشمش می‌توان از شاخص‌هایی نظیر نسبت تمرکز<sup>۸</sup> و شاخص هرfindال<sup>۹</sup> استفاده نمود (حسینی و هومنی، ۱۳۸۶)، ولی به دلیل عدم ضرورت در این پژوهش به این مقوله پرداخته نشد.

#### ۱-۵- اهداف تحقیق:

##### هدف اصلی

عمده‌ترین هدف این تحقیق بررسی عوامل تأثیرگذار بر قیمت صادراتی محصول کشمش می‌باشد.

##### هدف فرعی

در راستای هدف اصلی تحقیق، هدف جانبی زیر دنبال می‌گردد:

<sup>۸</sup> Concentration Ratio

<sup>۹</sup> Herfindal Index

بررسی رابطه کوتاه‌مدت و بلندمدت قیمت صادراتی با متغیرهای توضیحی با روشهای مختلف اقتصادسنجی

#### ۶-۱- سوالات تحقیق:

- آیا میزان صادرات کشمش تأثیر معنی‌داری روی قیمت صادراتی کشمش دارد؟
- \_ آیا میزان صادرات کشورهای رقیب ایران (ترکیه + ایالات متحده) تأثیر معنی‌داری روی قیمت صادراتی کشمش دارد؟
- \_ آیا نرخ واقعی ارز تأثیر معنی‌داری روی قیمت صادراتی کشمش دارد؟
- \_ آیا متغیر مجازی انقلاب اسلامی ایران تأثیر معنی‌داری روی قیمت صادراتی کشمش دارد؟
- \_ آیا متغیر مجازی جنگ تحمیلی ایران تأثیر معنی‌داری روی قیمت صادراتی کشمش دارد؟

#### ۷-۱- ساختار پایان‌نامه

ساختار پایان‌نامه بدین صورت است که فصل اول کلیات تحقیق را پوشش می‌دهد. در فصل دوم، نظریات مربوط به موضوع و مطالعات داخلی و خارجی صورت گرفته آورده شده است. در فصل سوم، مواد و روش‌های انجام تحقیق ارائه شده است. فصل چهارم، نتایج تجزیه و تحلیل مدل تحقیق و آزمون‌های مختلف اقتصادسنجی بیان شده است. در فصل پنجم، نتیجه‌گیری از تحقیق صورت گرفته و در ادامه پیشنهادها ارائه می‌گردد.

## ۲-۱- مقدمه

در این فصل ابتدا، نظریه‌های مرتبط با عرضه صادرات ارائه شده و سپس، مطالعات خارجی و داخلی صورت گرفته در ارتباط با موضوع پژوهش آورده شده است.

## ۲-۲- مبانی نظری

## ۲-۲-۱- تابع عرضه صادرات

مطالعات تجربی متعددی روی توابع عرضه صادرات صورت گرفته که عموماً بر پایه ویژگی حداکثرسازی سود بنگاه‌ها استوار می‌باشند (کامرون و زمان<sup>۱</sup>، ۲۰۰۵). تابع عرضه صادرات با فرض حداکثرسازی سود تولیدکننده با قید هزینه ثابت، تعیین می‌گردد. اوتکولو و همکاران<sup>۲</sup> (۲۰۰۳) ابراز می‌دارند در بلندمدت، عرضه صادرات به قیمت‌های نسبی، قیمت نهاده‌ها و ظرفیت تولید بستگی دارد. بر این اساس، مشتق‌های جزئی عرضه صادرات نسبت به قیمت صادراتی مثبت و نسبت به قیمت داخلی منفی است. انتظار می‌رود تولید داخلی بیشتر با ثابت بودن بقیه عوامل، مازاد صادراتی بیشتری را نتیجه دهد (هلیم<sup>۳</sup> و همکاران، ۲۰۰۵). همچنین علاوه بر موارد یاد شده، عرضه صادرات محصولات کشاورزی تحت تأثیر عواملی همچون قیمت داخلی محصول و درآمد کشورهای وارد کننده نیز واقع می‌شود. در کنار این عوامل، نوسان‌های نرخ ارز، قیمت صادراتی کالای موردنظر، شاخص بهای عمده فروشی کالاها، میزان تولید داخلی کالا و تولید ناخالص ملی کشور می‌تواند اثرات مهمی بر صادرات محصولات کشاورزی داشته باشند. برخی مطالعات نشان دادند که تغییرات نرخ ارز در مقایسه با تغییرات اسمی تأثیر بیشتری بر عرضه صادرات کالاها و کشاورزی دارد (محمودزاده و زیبایی، ۱۳۸۳ و عزیزی و یزدانی، ۱۳۸۵). در این راستا، بی‌ریا و جبل‌عاملی (۱۳۸۵) نشان دادند که میزان صادرات تحت تأثیر قیمت داخلی محصول، نرخ ارز، شاخص ظرفیت تولیدی، شوک‌های عرضه و قیمت جهانی و قیمت صادراتی محصول می‌باشد.

<sup>۱</sup> Cameron & Zaman

<sup>۲</sup> Utkulu et al

<sup>۳</sup> Haleem et al



## ۲-۲-۲- رابطه انتقالی نرخ ارز

قیمت صادراتی بر حسب پول داخلی از حاصل ضرب نرخ ارز و قیمت صادرات بر حسب پول خارجی (دریافتی صادرکننده از صدور هر واحد کالای صادراتی) به دست می‌آید. رابطه بین نرخ ارز و قیمت صادرات را در ادبیات اقتصادی، رابطه انتقالی نرخ ارز<sup>۱</sup> گویند. با تغییر نرخ ارز ممکن است قیمت صادرات تغییر کند. اینکه منظور از تغییر قیمت صادرات، تغییر برحسب پول کشور مقصد و یا برحسب پول داخلی است، بستگی به ساختار بازاری دارد که بنگاه‌ها در آن تولید می‌کنند. در شرایط رقابتی منظور از رابطه انتقالی نرخ ارز، تغییر قیمت صادرات برحسب پول داخلی ناشی از تغییر نرخ ارز است. در حالی که در شرایط غیر رقابتی، منظور از رابطه انتقالی تغییر قیمت صادراتی برحسب پول کشور مقصد به دلیل تغییر نرخ ارز است.

در شرایط رقابتی رابطه انتقالی نرخ ارز بر مبنای قانون قیمت واحد<sup>۲</sup> بنا نهاده شده است. قانون قیمت واحد بیان می‌کند که قیمت کالاهای تجاری در کشور داخل و خارج، برحسب یک واحد پول مشترک، برابر هستند. به عبارت دیگر، رابطه زیر برقرار است:

$$P = P^* E \quad (1-2)$$

به طوری که  $P$  و  $P^*$  قیمت کالا در داخل و خارج هستند و  $E$  نرخ ارز است.

اگر با تغییر نرخ ارز، تغییر قیمت صادرات کالا بر حسب پول داخلی به نسبت تغییر نرخ ارز باشد، قانون قیمت واحد برقرار بوده و رابطه انتقالی نرخ ارز کامل است. در شرایط رقابتی، کامل بودن رابطه انتقالی نرخ ارز در مورد یک اقتصاد باز کوچک صدق می‌کند. در چنین شرایطی صادرکنندگان با تقاضای کاملاً با کشش روبرو بوده و بنابراین کشور در بازارهای جهانی گیرنده قیمت است. اما اگر انحراف از قیمت یکسان اتفاق بیفتد و تغییر قیمت صادرات بر حسب پول داخلی کمتر از تغییر نرخ ارز باشد، رابطه انتقالی ناقص است. این امر در صورتی امکان پذیر است که کشور در بازارهای جهانی قیمت گذار بوده و با تغییر نرخ ارز می‌تواند قیمت صادرات برحسب پول خارجی را تغییر دهد (رحیمی، ۱۳۸۰، دویر و همکاران<sup>۳</sup>، ۱۹۹۳).

در شرایط غیر رقابتی، بنگاه‌های صادرکننده در تعیین قیمت نقش دارند و با تغییر نرخ ارز قیمت صادرات بر حسب پول کشور خارجی، تغییر می‌یابد. افزایش ارزش پول ملی (کاهش نرخ ارز) باعث

<sup>1</sup> Exchange Rate Pass-Through

<sup>2</sup> Law of One Price

<sup>3</sup> Dwyer et al

می‌شود که قیمت کالاهای صادراتی بر حسب پول خارجی برای خارجی‌ان افزایش یابد و کاهش ارزش پول ملی (افزایش نرخ ارز) قیمت کالاهای صادراتی در بازار خارجی را کاهش می‌دهد. افزایش یا کاهش قیمت صادرات بر حسب پول خارجی، به نسبت تغییر نرخ ارز نیست و یک درصد تغییر نرخ ارز، قیمت کالاهای صادراتی را کمتر از یک درصد تغییر می‌دهد. به عبارت دیگر، رابطه انتقالی نرخ ارز ناقص است (همان منبع، ۱۳۸۰، پارسلی<sup>۱</sup>، ۱۹۹۳).

یکی از عواملی که باعث می‌شود تا قیمت صادرات بر حسب پول داخلی، تغییر پیدا کند و درصدی از تأثیر اولیه نرخ ارز بر قیمت صادراتی بر حسب پول خارجی خنثی گردد، اثر مستقیم قیمت‌گذاری برای بازار<sup>۲</sup> (PTM) یا قیمت‌گذاری استراتژیک می‌باشد. با تغییر نرخ ارز قیمت صادرات بر حسب پول خارجی تغییر پیدا می‌کند. بنگاه‌های صادرکننده در واکنش به تغییر نرخ ارز، ممکن است یکی از سه حالت را انتخاب کنند: الف) بنگاه‌ها ممکن است تمام تغییرات نرخ ارز را به قیمت صادرات بر حسب پول خارجی (قیمت خریدار) انتقال دهند. ب) تمام تغییرات نرخ ارز را خنثی (جذب) کنند. ج) درصدی از تغییرات نرخ ارز را خنثی کرده و بقیه تغییرات را به قیمت صادرات بر حسب پول خارجی انتقال دهند.

اگر ارزش پول ملی افزایش پیدا کند، بنگاه‌های صادرکننده ای که با تابع تقاضای نزولی روبرو هستند، به منظور حفظ موقعیت خود در بازار، قیمت را به گونه‌ای تعیین می‌کنند که رقابت‌پذیری آنها حفظ شود. بدین منظور با توجه به این که قیمت‌گذاری با سود نهایی ارتباط پیدا می‌کند، در واکنش نسبت به تغییر نرخ ارز با کاهش سود نهایی، قیمت صادرات بر حسب پول خارجی را کاهش می‌دهند. در واقع بنگاه‌های صادرکننده برای محدود کردن تأثیر افزایش ارزش پول ملی بر قیمت صادرات بر حسب پول خارجی، سود نهایی و قیمت صادرات را کاهش می‌دهند.

از طرف دیگر، اگر ارزش پول ملی کاهش پیدا کند، قیمت کالاهای صادراتی بر حسب پول خارجی کاهش پیدا می‌کند. بنگاه‌ها به منظور به دست آوردن سود بیشتر، سود نهایی و قیمت صادرات بر حسب پول داخلی را افزایش می‌دهند. چنین رفتار قیمت‌گذاری، به این دلیل که قیمت صادرات بر اساس شرایط رقابت در بازار خارج تعیین می‌شود، توسط کروگمن (۱۹۷۸) و دیگران قیمت‌گذاری برای بازار نامیده شده است (همان منبع، ۱۳۸۰، آتوکورالا و منون<sup>۳</sup>، ۱۹۹۴).

<sup>1</sup> Parsley

<sup>2</sup> Pricing to Market

<sup>3</sup> Authokorala & Menon

## ۲-۳- پیشینه تحقیق

## ۲-۳-۱- مطالعات خارجی

تحقیقات مشابهی در رابطه با موضوع تحقیق در خارج از کشور صورت گرفته که برخی از آنها ذیلاً ارائه می‌شود:

سقائیان و رید<sup>۱</sup> (۲۰۰۳) در مطالعه ای پیرامون همگرایی هزینه نهایی به مدلهای قیمت گذاری برای بازار برای تولیدات کشاورزی در ایالات متحده به این نتیجه رسیدند که بازارهای بین المللی، به غیر از گوشت گاو و خوراک دام، در حالتی که تفاوت های قیمتی میان کشورها حداقل است، همگرایی قیمت دارند. همچنین، صادرکنندگان این توانایی را دارند که در زمانی که قیمت عمده‌فروشی ایالات متحده پایین می رود، درآمدشان را افزایش دهند. کاهش قیمت های صادراتی زمانی که قیمت‌های عمده فروشی پایین است و سپس افزایش قیمت‌های صادراتی بعد از واکنش به قیمت‌های عمده فروشی ممکن است در بلند مدت سهم بازار را تحت تأثیر قرار دهد.

کامرون و همکاران<sup>۲</sup> (۲۰۰۴) در مطالعه در مورد اثر نوسان نرخ ارز روی صادرات ماهی در اوگاندا برای دوره ۲۰۰۱-۱۹۹۴ با الگوی خودتوضیح با وقفه‌های توزیعی نتیجه گرفتند که صادرات ماهی این کشور بطور منفی و معنی‌داری با نوسان نرخ ارز همبستگی دارد. همچنین نتایج نشان داد که رابطه منفی و معنی‌داری بین صادرات ماهی آب شیرین و تغییر نرخ ارز در مناطق گرمسیری اوگاندا وجود دارد.

هلیم و همکاران (۲۰۰۵) در مطالعه خود پیرامون تابع عرضه صادرات برای مرکبات در پاکستان برای دوره ۲۰۰۴-۱۹۷۵ و با روش همجمعی جوهانسن- جوسیلیوس دریافتند که قیمت صادراتی، تولید داخلی و نرخ ارز روی صادرات مرکبات تأثیر می‌گذارند.

کامرون و خیرالزمان (۲۰۰۵) در پژوهشی در ارتباط با برآورد تابع عرضه صادرات برای صنایع فرش پاکستان در دوره ۲۰۰۳-۱۹۷۰ با بکارگیری الگوی تصحیح خطا صادرات را روی تولید ناخالص داخلی، قیمت نسبی (قیمت صادرات به قیمت داخلی) و نرخ ارز و نوسانات نرخ ارز برآورد نمود، نتایج نشان داد که تولید داخلی، نرخ ارز و نوسانات نرخ ارز و متغیر صادرات ایران، عرضه صادرات را تحت تأثیر قرار می‌دهد.

<sup>1</sup> Saghaian & Reed

<sup>2</sup> Cameron et al.

تودانی و مونیاما<sup>۱</sup> (۲۰۰۵) در تحقیقی روی نوسان نرخ ارز و صادرات در افریقای جنوبی در دوره ۲۰۰۴-۱۹۸۴ با الگوی خودتوضیح با وقفه‌های توزیعی به این نتیجه رسیدند که از لحاظ آماری رابطه معنی‌داری بین جریان صادرات افریقای جنوبی و نوسان نرخ ارز یا وجود ندارد و یا زمانی که رابطه معنی‌داری باشد، مثبت است.

دیکل و ریو<sup>۲</sup> (۲۰۰۶) در مطالعه‌ای در مورد نوسانات نرخ ارز، محدودیتهای مالی و حاشیه‌های بازار و صادرات به این نتیجه رسیدند که میزان صادرات در سطح بنگاه بطور معنی‌داری از طریق نوسانات نرخ ارز متأثر می‌شود. صادرات کشش بالایی نسبت به نرخ ارز دارد.

ویگفوسان و همکاران<sup>۳</sup> (۲۰۰۷) در کار تحقیقی درباره اثر نرخ ارز در قیمتهای صادراتی به این نتیجه رسیدند که قیمت محصول صادراتی به ایالات متحده، نسبت به قیمت صادرات صورت گرفته به سایر نقاط واکنش بیشتری به نرخ ارز نشان می‌دهد. همچنین تغییر در حساسیت قیمت صادراتی به نرخ ارز توسط عوامل خاص داخلی و منطقه‌ای تحت تأثیر قرار می‌گیرد.

## ۲-۳-۲- مطالعات داخلی:

نیک اقبالی<sup>۱</sup> (۱۳۷۸) در پژوهشی روی اثر نوسانات نرخ واقعی ارز و انحراف آن از مسیر تعادلی بر عرضه صادرات محصولات کشاورزی نتیجه گرفت که انحراف نرخ واقعی ارز نسبت به مسیر تعادلی بلند مدت آن، نوسانات نرخ واقعی ارز و فشار تقاضای داخلی برای کالاهای قابل صدور بر عرضه صادرات محصولات کشاورزی اثر منفی دارند و قیمت نسبی محصولات کشاورزی و تغییرات ناگهانی در تولیدات کشاورزی و پیشرفتهای فنی بر عرضه صادرات محصولات کشاورزی اثر مثبت دارند.

رحیمی<sup>۱</sup> (۱۳۸۰) در مطالعه خود در ارتباط با بررسی تأثیر تغییرات نرخ ارز بر قیمت صادراتی و تراز تجاری در ایران برای سری زمانی ۱۳۷۶-۱۳۴۵ با روش حداقل مربعات سه مرحله‌ای به این نتیجه رسید که کاهش ارزش ریال، قیمت صادراتی بر حسب پول خارجی را کاهش می‌دهد اما در نتیجه کاهش ارزش پول ملی، قیمت صادرات بر حسب پول داخلی افزایش می‌یابد، بنابراین این

<sup>۱</sup> Todani & Munyama.

<sup>۲</sup> Dekle R. & Ryoo Heajin H.

<sup>۳</sup> Vigfussan et al.