



وزارت علوم تحقیقات و فناوری



موسسه آموزش عالی
علامه محدث نوری (ره)

(غیر دولتی - غیر انتفاعی)

دانشکده اقتصاد

پایان نامه ی دوره کارشناسی ارشد در رشته علوم اقتصادی

موضوع :

بررسی اثر نوسانات نرخ ارز بر صادرات و واردات

محصولات بخش کشاورزی

استاد راهنما :

دکتر مجتبی مجاوریان

استاد مشاور :

دکتر امیر منصور طهرانچیان

استاد داور :

دکتر محمد تقی گیلک

دانشجو :

شاهین جمالی

شهریور ۱۳۹۳

باسمه تعالی

تعهد نامه اصالت پایان نامه

اینجانب **شاهین جمالی** فرزند **عبدالله** دانشجوی رشته **علوم اقتصادی** مقطع کارشناسی ارشد دانشگاه علامه محدث نوری (ره) بدینوسیله اصالت کلیه مطالب و مندرجات موجود در مباحث مطروحه در این پایان نامه را با عنوان **بررسی اثر نوسانات نرخ ارز بر صادرات و واردات محصولات بخش کشاورزی** تأیید و تصدیق کرده، اعلام می‌نمایم که تمامی محتوای این پایان نامه حاصل مطالعه، پژوهش و تدوین خودم بوده و به هیچ وجه رو نویسی از پایان نامه و یا هیچ اثر یا منبع اعم از داخلی، خارجی و یا بین‌المللی، نبوده و تعهد می‌نمایم در صورت اثبات عدم اصالت آن و یا احراز عدم صحت مفاد و یا لوازم این تعهد نامه در هر مرحله از مراحل که منتهی به فارغ‌التحصیلی شده و یا پس از آن و یا تحصیل در مقاطع دیگر و یا اشتغال و ...، دانشگاه حق دارد ضمن اعلام رد پایان نامه، نسبت به لغو و ابطال مدرک تحصیلی مربوط اقدام نماید. مضافاً به اینکه کلیه مسئولیت‌ها و پیگردها و پیامدهای قانونی و نیز خسارات مادی و معنوی وارده از هر حیث متوجه اینجانب می‌باشد.

شاهین جمالی

تاریخ و امضاء

تقدیم به

روح پاک پدرم، که دلسوزانه به من آموخت تا چگونه در عرصه زندگی، ایستادگی را تجربه نمایم.
مادرم، دریای بی کران فداکاری و عشق که وجودم برایش همه رنج بود و وجودش برایم همه مهر.
همسر مهربانم، اسطوره زندگی ام، پناه خستگی ام و امید بودم.
و فرزند دلبندم، که با حضورش همچو باران رحمت الهی زندگی ام را سرشار از طراوت نمود.

(وَيُزَكِّيهِمْ وَيُعَلِّمُهُمُ الْكِتَابَ وَالْحِكْمَةَ)

سپاسگزاری

شکر شایان نثار ایزد مَنان که توفیق را رفیقِ راهم ساخت تا این پایان‌نامه را به پایان برسانم.

از استاد فاضل و اندیشمند جناب آقای دکتر مجاوریان به عنوان استاد راهنما که همواره مرا مورد لطف و محبت قرار داده‌اند، کمال تشکر را دارم.

همچنین از استادان عالی‌قدرم جناب آقای دکتر گیلک که زحمت داوری و جناب آقای دکتر طهرانچیان که زحمت مشاوره‌ی این پایان‌نامه را متحمل شدند، صمیمانه تشکر می‌کنم.

بر خود لازم می‌دانم که مراتب سپاس را از بزرگوارانی بجا آورم که اگر دست یاریگرشان نبود، هرگز این پایان‌نامه به انجام نمی‌رسید.

چکیده

بخش کشاورزی بستر فعالیت اقتصادی نزدیک به نیمی از جمعیت کشور به صورت مستقیم و غیر مستقیم است. طبق آماربانک مرکزی سهم صادرات کالاهای کشاورزی و سستی در سال های ۵۹ معادل ۹۳ درصد و در سال ۸۱ برابر با ۳۳ درصد و در سال ۸۸ به ۱۹ درصد از کل صادرات غیر نفتی کشور بوده است. هدف از این پژوهش بررسی اثر نوسانات نرخ ارز بر صادرات و واردات محصولات بخش کشاورزی است. برای این منظور، نوسانات نرخ ارز به دو بخش قابل پیش بینی و غیر قابل پیش بینی تقسیم شده است. افزایش در بخش غیر قابل پیش بینی به عنوان تکانه‌ی مثبت و کاهش آن به عنوان تکانه‌ی منفی در نظر گرفته شده و اثرات آن مورد بررسی قرار گرفت. داده‌های تحقیق شامل نرخ ارز به صورت میانگین ماهانه از داده‌های صندوق بین‌المللی پول دریافت شده و داده‌های صادرات و واردات محصولات کشاورزی از مرکز آمار و اطلاعات گمرک ایران گرفته شد. این داده‌ها به صورت تواتر ماهانه بوده و از فروردین سال ۱۳۸۱ تا اسفند سال ۱۳۹۰ را شامل می‌شود. روش مورد استفاده در پژوهش مدل ARDL است. نتایج تحقیق نشان می‌دهد، تکانه‌های مثبت و منفی نرخ ارز، با صادرات رابطه‌ی معکوس و با واردات رابطه‌ی مستقیم دارند. به شکلی که ۱ درصد افزایش تکانه‌ی مثبت، میزان صادرات را ۶/۸۵ درصد کاهش و میزان واردات را ۳/۵۳ درصد افزایش می‌دهد. همچنین ۱ درصد افزایش تکانه‌ی منفی، میزان صادرات را ۲/۳۵ درصد کاهش و میزان واردات را ۳/۲۹ درصد افزایش می‌دهد. همچنین این تحقیق نشان می‌دهد تکانه‌های مثبت و منفی اثرات متفاوتی بر تجارت محصولات کشاورزی داشته‌اند.

واژه های کلیدی

صادرات، واردات، نرخ ارز، نوسانات نرخ ارز، اثر نامتقارن، ARDL

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
	فصل اول - کلیات پژوهش
۲	مقدمه
۳	۱-۱ ساختار تحقیق
۳	۱-۱-۱ تعریف مساله
۵	۲-۱-۱ فرضیات
۶	۳-۱-۱ هدف از تحقیق
۶	۴-۱-۱ اهمیت موضوع
۹	۵-۱-۱ روش تحقیق
۱۰	۲-۱ تعریف مفاهیم
	فصل دوم - ادبیات موضوع
۱۳	مقدمه
۱۳	۱-۲ مبانی نظری
۱۴	۱-۱-۲ شرط مارشال - لرنر
۱۴	۲-۱-۲ روش جذب
۱۵	۳-۱-۲ منحنی جی
۱۶	۲-۲ مبانی تجربی
۱۶	۱-۲-۲ مطالعات خارجی
۱۸	۲-۲-۲ مطالعات داخلی

فصل سوم - روش تحقیق و تشریح الگو

۲۳	مقدمه
۲۳	۱-۳ منابع و روش جمع آوری داده ها
۲۳	۲-۳ روش تحقیق
۲۴	۱-۲-۳ نوسان پذیری نرخ ارز با استفاده از الگوی ARIMA
۲۴	۲-۲-۳ الگوی پویای خودبازگشتی با وقفه های توزیعی ARDL
۲۹	۳-۲-۳ الگوی تصحیح خطا
۳۱	۳-۳ ساختار الگو

فصل چهارم - یافته ها و نتایج پژوهش

۳۴	مقدمه
۳۴	۱-۴ توصیف داده ها
۴۰	۲-۴ آزمون پایایی
۴۱	۳-۴ تخمین الگو
۴۱	۱-۳-۴ تخمین الگوی نوسانات نرخ ارز
۴۳	۲-۳-۴ تخمین الگوهای صادرات و واردات
۴۵	۴-۴ آزمون فرضیات

فصل پنجم - نتیجه گیری و پیشنهاد

۴۸	مقدمه
۴۸	۱-۵ نتیجه گیری
۴۹	۲-۵ پیشنهادها
۵۰	منابع و ماخذ
۵۳	چکیده انگلیسی

فهرست جداول

صفحه	عنوان
۴۱	جدول (۱-۴) آزمون دیکسی فولر تعمیم یافته برای بررسی پایایی سری های زمانی مورد استفاده
۴۲	جدول (۲-۴) نتایج تخمین الگوی سری زمانی نرخ ارز برای محاسبه بخش قابل پیش بینی تغییرات نرخ ارز
۴۴	جدول (۳-۴) نتایج تخمین برای الگوی صادرات
۴۵	جدول (۴-۴) نتایج تخمین برای الگوی واردات

فهرست نمودارها

صفحه	عنوان
۳۵	نمودار (۴-۱) نرخ ارز ماهانه طی دوره فروردین ۸۱ تا اسفند ۱۳۹۱
۳۶	نمودار (۴-۲) انحراف از میانگین نرخ ارز ماهانه طی دوره فروردین ۱۳۸۱ تا اسفند ۱۳۹۱
۳۷	نمودار (۴-۳) میزان واردات ماهانه انواع محصولات کشاورزی طی دوره فروردین ۱۳۸۱ تا اسفند ۱۳۹۱
۳۸	نمودار (۴-۴) میزان صادرات ماهانه انواع محصولات کشاورزی طی دوره فروردین ۱۳۸۱ تا اسفند ۱۳۹۱
۳۹	نمودار (۴-۵) میانگین ماهانه واردات انواع محصولات کشاورزی طی دوره فروردین ۱۳۸۱ تا اسفند ۱۳۹۱
۴۰	نمودار (۴-۶) میانگین ماهانه صادرات انواع محصولات کشاورزی طی دوره فروردین ۱۳۸۱ تا اسفند ۱۳۹۱
۴۳	نمودار (۴-۷) مقایسه بین تغییرات پیش‌بینی شده و محقق شده لگاریتم نرخ ارز

فصل اول

کلیات پژوهش

مقدمه

اقتصاد هر کشور را می توان در سه بخش صنعت، کشاورزی و خدمات مورد مطالعه قرار داد. برنامه های کلان اقتصادی نیز بر اساس همین مطالعات تنظیم می شود. برای اینکه یک برنامه اقتصادی موفق تنظیم شود، باید نقاط ضعف و قوت کشور در سه بخش مذکور تا حد ممکن شناسایی شده، سپس با تاکید بر توانایی ها، تلاش کرد تا نقایص سایر بخش ها را رفع نموده و کشور را به سمت رشد و توسعه پایدار سوق داد. دلایل تاکید بر بخش کشاورزی در ایران را می توان در دو مبحث مورد بررسی قرار داد. ابتدا نقاط قوت بخش کشاورزی، سپس نقاط ضعف سایر بخش ها.

ایران کشوری گسترده با اقلیم های متفاوت است که می تواند در مناطق مختلف، در تمام فصول سال جهت کشت محصولات مختلف کشاورزی مورد بهره برداری قرار گیرد. از سویی با توجه به میزان بالای واردات محصولات مختلف کشاورزی به کشور، توجه به این بخش می تواند از خروج ارز از کشور کمک شایانی داشته باشد. همچنین با توجه بازارهای موجود در کشورهای همسایه از جمله عراق، افغانستان و کشورهای تازه استقلال یافته در شمال ایران، می توان برای صادرات در بخش کشاورزی نیز افق روشنی را متصور بود. از سوی دیگر بخش صنعت در کشور نیاز بیشتری به فن آوری روز دنیا دارد که با توجه به تحریم های غرب جهت جلوگیری از واردات فن آوری روز به کشور، این بخش آسیب بیشتری دیده است.

حال با توجه به مطالب مذکور و با فرض اینکه می توان بخش کشاورزی به عنوان پیشرو در رشد و توسعه در نظر گرفته شود، باید عوامل مختلف اثرگذار بر این بخش را مورد بررسی قرار داد. میزان صادرات و واردات محصولات بخش کشاورزی می تواند از عوامل مختلف اثرپذیر بوده و بر تولید و سایر مولفه های این بخش اثر گذار باشد. از این رو پژوهش حاضر تلاش دارد تا میزان و نحوه اثر نوسانات نرخ ارز که یکی از مهم ترین عوامل موثر بر تجارت خارجی هر کشور است را بر روی صادرات و واردات محصولات بخش کشاورزی مورد بررسی قرار دهد.

۱-۱ ساختار تحقیق

این پژوهش در پنج فصل سازماندهی شده است. در فصل اول اهمیت و تعریف موضوع، فر ضیبه های تحقیق به اختصار معرفی می شوند. فصل دوم به مروری بر ادبیات موضوع از دیدگاه نظری و نیز بررسی مطالعات تجربی (داخلی و خارجی) اختصاص می یابد. در فصل سوم، روش تحقیق و الگوها به تفصیل معرفی می شود. در فصل چهارم نتایج بحث ارائه می شوند و فصل پایانی به نتیجه گیری و آرایه پیشنهادهای مبتنی بر پژوهش اختصاص می یابد.

۱-۱-۱ تعریف مساله

یکی از مهمترین مسایل اقتصادی کشورها تراز تجاری است. سیاستگذاران تلاش می کنند که تراز تجاری در حالت تعادل قرار داشته باشد. (رحیمی - طاهری نیا ۱۳۸۳) برای دستیابی به تراز تجاری مناسب باید تولید داخلی را بهبود بخشید زیرا افزایش تولید از یک سوباعت کاهش تقاضا برای کالای وارداتی شده و از سوی دیگر میتواند به افزایش صادرات کمک کند.

افزایش سطح تولید داخلی از جمله اهداف مهم کشورهای مختلف و به ویژه کشورهای در حال توسعه است. افزایش تولید زمینه ساز دستیابی به اهداف توسعه و شکوفایی اقتصادی در هر کشور است. (قطمیری و شرافتیان ۱۳۸۶)

صادرات کشورهای در حال توسعه غالباً به یک یا چند محصول عمده کشاورزی و منابع طبیعی خام محدود می شود که میزان آن بیشتر بین ۸۰ تا ۹۰ درصد ارزش کل صادرات است. (پیری ۱۳۸۶)

نفت سهم اصلی صادرات ایران را تشکیل می دهد که این اقتصاد تک محصولی خود باعث بروز مشکلات فراوان می شود. برای برون رفت از این معضل باید راه های تقویت سایر بخش های تولید در کشور و نیز متغیرهای اثرگذار بر آن بخش ها را مورد بررسی قرار داد. یکی از این بخش ها که نقش مهمی در میزان تولید در ایران دارد، بخش کشاورزی است.

طبق آمار بانک مرکزی سهم صادرات کالاهای کشاورزی و سنتی در سال های ۵۹ - ۶۴ - ۶۹ - ۷۵ - ۷۶ - ۸۱ و ۸۸ به ترتیب معادل ۹۳٪ - ۸۰٪ - ۷۹٪ - ۵۳٪ - ۴۰٪ - ۳۳٪ - و ۱۹٪ از کل صادرات غیر نفتی کشور بوده است.

با توجه به سهم بخش کشاورزی از کل صادرات غیرنفتی و توانایی های بالقوه آن، یعنی تنوع آب و هوایی کم نظیر کشور، امکانات قابل توجه در خاک مناسب کشاورزی، تنوع و میزان تولید محصولات کشاورزی و توجه به اینکه بخش مذکور بستر فعالیت اقتصادی نزدیک به نیمی از جمعیت کشور است و همچنین وابستگی کمتر این بخش به تکنولوژی پیچیده، (با توجه به بحث تحریم های اقتصادی در جهت جلوگیری از ورود فناوری روز به کشور) به نظر می رسد تحقیق پیرامون عواملی که صادرات (و واردات) این بخش را تحت تاثیر قرار می دهند، ضروری باشد. (هژبرکیانی و نیک اقبالی ۱۳۷۹)

البته فعالیت نیروی کار در بخش کشاورزی در ادامه کاهش یافته است، به طوری که در سال ۱۳۸۷ به حدود ۲۰ درصد از کل اشتغال رسیده است. (پیشرو و عزیززی ۱۳۸۸) با وجود این همچنان می توان رشد بخش کشاورزی را یکی از راه های خروج از بحران اقتصادی کنونی در نظر گرفت. تولید بخش کشاورزی می تواند باعث تغییر در صادرات و واردات محصولات کشاورزی شود و از طرفی میزان تقاضای واردات و صادرات محصولات کشاورزی بر تولید این بخش اثر می گذارد. میزان تقاضای واردات و صادرات محصولات کشاورزی تابعی از عوامل مختلف است. یکی از این عوامل نرخ ارز، تغییرات آن و بحث های مربوط به نظام ارزی کشور است.

در ایران تا قبل از سال ۱۳۸۱ نرخ ارز واحدی وجود نداشت، بلکه انواع نرخ های ارز حمایتی، رقابتی و نرخ ارز بازار غیررسمی در اقتصاد کشور رایج بوده است. از سال ۱۳۸۱ به بعد که سیاست یکسان سازی نرخ های ارز اجرا شد، انواع نرخ های ارز رقابتی، حمایتی و مانند آن حذف شدند و از آن زمان تاکنون (سال ۱۳۹۰) برای هر پول خارجی یک نرخ ارز معین (نرخ ارز مرجع بانک مرکزی) رایج است. (دفتر مطالعات اقتصادی مرکز پژوهش های مجلس ۱۳۹۰)

مطابق الگوهای عبور نرخ ارز^۱، نرخ ارز در تعیین قدرت رقابتی صادرات کشورها بسیار حایز اهمیت بوده و تعیین اندازه انتقال اثرات نرخ ارز بر قیمت صادرات می تواند در برنامه ریزی های توسعه ای صادرات ایفای نقش نماید. (سجودی وهمکاران ۱۳۹۰) با کاهش نرخ ارز قیمت کالاهای داخلی نسبت به کالاهای خارجی افزایش می یابد و قدرت رقابتی صادرکنندگان در مقابل رقبای خارجی تضعیف شده و در نتیجه میزان واردات افزایش و صادرات کاهش می یابد و از این راه بر تراز تجاری اثر منفی خواهد گذاشت. در مقابل با افزایش نرخ ارز قیمت کالاهای داخلی نسبت به کالاهای خارجی کاهش می یابد و با افزایش صادرات و کاهش واردات تراز تجاری تقویت خواهد شد. بنابراین تغییر نرخ ارز با تغییر در میزان واردات و صادرات بر تراز تجاری اثرمی گذارد. البته کسش بخش های مختلف اقتصاد کشور نسبت به تغییرات نرخ ارز به یک میزان نیست و نمی توان مطالعات در مورد یک بخش را ملاک برنامه ریزی برای کل اقتصاد قرار داد، ولیکن می توان با انتخاب یک سیاست ارزی مناسب برای یک بخش، اثرات منفی آن بر سایر بخش ها را توسط سایر اهرم ها مانند سیاست های مالی تعدیل نمود. در پژوهش حاضر تلاش بر این است تا با فرض ثابت بودن سایر عوامل بجز نوسانات نرخ ارز، ابتدا تاثیر این نوسانات را بر روی صادرات و واردات بخش کشاورزی مورد بررسی قرار داده و در ادامه با تجزیه و تحلیل مکانیزم اثر نوسانات نرخ ارز بر صادرات و واردات این بخش، به انتخاب مناسب ترین نظام تعیین نرخ ارز برای بخش مذکور کمک نماید.

۱-۱-۲ فرضیات

- نوسانات نرخ ارز اثر معنی دار و مستقیم بر صادرات محصولات کشاورزی دارد.
- واردات محصولات کشاورزی با نوسانات نرخ ارز رابطه عکس دارد.
- تاثیر نوسانات نرخ ارز بر واردات بیشتر از صادرات محصولات کشاورزی است.

^۱ Exchange Rate Pass-Through

۳-۱-۱ هدف از تحقیق

اقتصاد ایران بویژه در دهه‌ی هشتاد و سالهای ابتدایی دهه‌ی نود با مسائل مختلف در خصوص نرخ ارز مواجه بوده است که از آن جمله می‌توان به یکسان سازی نرخ ارز توسط دولت در سال ۸۱ و نوسانات شدید نرخ ارز در سال‌های ۹۰ به بعد اشاره نمود. تحقیق حاضر سعی دارد با تمرکز بر روی نوسانات نرخ ارز در ایران، نوع و میزان اثر آن را بر صادرات و واردات محصولات بخش کشاورزی در بازه زمانی بین سالهای ۸۱ تا ۹۱ مورد بررسی قرار دهد. نتایج این تحقیق می‌تواند توسط سیاست‌گذاران کلان بخش کشاورزی کشور مورد استفاده قرار گیرد. همچنین این پژوهش می‌تواند در رابطه با تعیین نظام ارزی کشور نیز مفید واقع گردد.

۴-۱-۱ اهمیت موضوع

تجارت خارجی هر کشور یکی از بخش‌های عمده‌ی اقتصاد آن محسوب می‌شود و نقشی مهم در تعیین سرنوشت و آینده‌ی کشور می‌تواند داشته باشد به طوری که عده‌ای از جمله نئوکلاسیک‌ها، آن را موتور رشد اقتصاد نامیده‌اند. (هابرلر^۲ ۱۹۵۹) بخش کشاورزی به عنوان یک بخش مهم در اقتصاد ایران مطرح است. یکی از عوامل مهم و تاثیرگذار در تجارت خارجی این بخش، نرخ ارز و روند تغییرات آن است که این نرخ براساس نظام ارزی کشور تعیین می‌شود.

نرخ ارز هر کشور از متغیرهای مهم اقتصادی در این زمینه است. نرخ ارز از عوامل متعدد اقتصادی و غیر اقتصادی اثر می‌پذیرد و بر عوامل متعدد اقتصادی، همچون صادرات، واردات، سرمایه‌گذاری، رشد و اشتغال اثر می‌گذارد. (قطمیری و شرافتیان ۱۳۸۶)

در راستای آسیب شناسی عوامل تأثیرگذار بر صادرات غیرنفتی، نرخ ارز متغیری است که باید مورد ارزیابی قرار گیرد. البته تأثیر ارز باید از دو دیدگاه عرضه و تقاضای صادرات بررسی شود. در حالت اول، ارز رابطه‌ای مثبت با عرضه صادرات دارد و طبیعی است که افزایش نرخ ارز، درآمد بیشتری را برای صادرکنندگان به

² G.V. Haberler

ارمغان می آورد. اما در حالت دوم، نرخ ارز با تقاضای صادرات رابطه ای معکوس و منفی دارد. افزایش نرخ ارز در این دیدگاه، یعنی افزایش هزینه واردات برای کشورهای طرف تجاری ایران که از این جنبه، رشد نرخ ارز حتی می تواند به کاهش صادرات غیرنفتی منجر شود. به همین جهت است که برای کارایی در سیاست های ارزی خود، باید نگاه ما، هم متوجه عرضه صادرات باشد و هم معطوف به تقاضای صادرات. یعنی باید علاوه بر رصد وضعیت صادر کنندگان کشور، به مطالعه کشش بازارهای صادراتی هم پردازیم. با این رویکرد، نه ثبات دستوری و نه افزایش بی دلیل نرخ ارز، هیچ کدام نمی توانند گره گشای توسعه صادرات غیرنفتی باشند. (ماهنامه اقتصاد ایران تیرماه ۱۳۹۰)

مسئله تنظیم نرخ ارز یکی از مسائل اساسی و پیچیده در کشورهای در حال توسعه است. اهمیت و پیچیدگی موضوع تنظیم نرخ ارز از این مسأله نشأت می گیرد که تعیین ارزش پول ملی یک کشور بر اساس پول های خارجی، باید به شکلی باشد که سبب ارتباط هماهنگ اقتصاد داخلی با اقتصاد بین المللی گردد. حال اگر نرخ ارز، همگام و هماهنگ با تحولات و تغییرات اقتصادی تعدیل نگردد، موجب انحراف نرخ ارز حقیقی و تنظیم نامناسب آن گشته و نشان می دهد که جهت گیری سیاست های کلان داخلی و خارجی اقتصاد اشتباه است. (محبی آشتیانی ۱۳۹۱)

نرخ ارز به عنوان معیار ارزش برابری پول ملی یک کشور در برابر پول کشورهای دیگر، منعکس کننده وضعیت اقتصادی آن کشور در مقایسه با شرایط اقتصادی سایر کشورها است. در یک اقتصاد باز نرخ ارز به دلیل ارتباط متقابل آن با سایر متغیرهای داخلی و خارجی، متغیری کلیدی به شمار می رود که سیاست های اقتصادی داخلی و خارجی و تحولات اقتصادی تأثیرات بسیاری بر آن می گذارند. در مقابل، نرخ ارز نیز متغیری است که می تواند عملکرد اقتصاد و متغیرهای اقتصادی را تحت تأثیر قرار دهد. (حلافی و دیگران ۱۳۸۳)

به طور کلی انواع رژیم ارزی در نقاط مختلف دنیا عبارتند از:

رژیم ارزی ثابت: در این حالت نرخ ارز به نحوی ثابت می شود که تغییر نرخ برابری یا تغییر رژیم ارزی، بسیار مشکل و پرهزینه است. در سال ۱۹۹۹ حدود ۹۰ کشور دنیا، از رژیم ارزی کاملاً ثابت و یا رژیم ارزی تقریباً

ثابت استفاده نموده اند. در این نظام ارزی، مقامات پولی و ارزی یک کشور بر اساس مقتضیات نرخ هدفی را مشخص و با استفاده از منابع ذخایر ارزی آن را مورد حمایت قرار داده و به این ترتیب قیمت آن را در بازار تثبیت می نمایند.

رژیم های ارزی میانی: در این حالت نرخ ارز در یک نرخ ثابت تثبیت نمی شود، اما بانک مرکزی در قالب یک روش از قبل تعیین شده نوسانات نرخ ارز را محدود و کنترل می کند. نرخ شناور مدیریت شده که در آن با خرید و فروش ارز در بازار از جانب دولت، از نوسانات زیاد نرخ ارز جلوگیری می شود، در این نوع رژیم ها قرار می گیرد.

رژیم ارزی شناور: در این حالت نرخ ارز به طور آزاد بر مبنای عرضه و تقاضای بازار ارز تعیین شده و بانک مرکزی در بازار ارز دخالت نمی کند. این رژیم ارزی در سال ۱۹۹۹ در ۵۰ کشور جهان رواج داشت. در تعیین نوع نظام ارزی، ملاحظاتی وجود دارد که متناسب با وضعیت اقتصادی جوامع، باید به آنها توجه نمود. عمده ترین این ملاحظات عبارتند از؛

درجه باز بودن اقتصاد: در اقتصادهای نسبتاً بسته (با تجارت خارجی محدود)، رژیم های شناور کاربرد بیشتری دارند، زیرا اقتصاد این کشورها از تحولات اقتصادی خارجی تأثیرپذیری کمتری داشته و دامنه نوسانات نرخ ارز در آنها از تحولات خارجی تأثیر کمتری می پذیرد.

میزان تولید ناخالص ملی (اندازه اقتصاد): نظام های شناور بیشتر در اقتصادهای بزرگتر و قوی تر جریان دارند.

تنوع اقتصاد به لحاظ کالاهای صادراتی: رژیم های شناور بیشتر در اقتصادهای متنوع از لحاظ تولید و صادرات وجود دارند.

گسترده‌گی بازارهای مالی و تحرک سرمایه: در کشورهایی که تحرک بالای سرمایه وجود دارد و بازارهای مالی آن توسعه یافته هستند، حفظ رژیم های ثابت مشکل است.

علاوه بر موارد فوق، تحرک نیروی کار، تکانه های اسمی داخلی و تکانه های واقعی در اقتصاد، اختلاف سطح تورم داخلی با تورم خارجی و تمرکز جغرافیایی تجارت خارجی با سایر کشورها نیز در تعیین نظام ارزی نقش دارند. (محمدی ۱۳۸۵)

واضح است که انتخاب نظام ارزی کشور و تعیین نرخ ارز از سوی دولت بر شاخص های مختلف اقتصادی تاثیر می گذارد، اما برای تصمیم گیری در مورد نرخ ارز لازم است تا نوع و میزان اثرات مثبت و منفی هر تصمیم بر روی بخش های مختلف اقتصادی به تفکیک مورد بررسی قرار گیرد، سپس برآیند این اثرات را محاسبه کرده و مناسب ترین تصمیم اتخاذ شود. با توجه به اهمیت بخش کشاورزی در اقتصاد ایران، پژوهش حاضر تلاش دارد تاثیر تغییرات نرخ ارز بر روی صادرات و واردات این بخش را مورد بررسی قرار دهد.

۱-۱-۵ روش تحقیق

به منظور الگوسازی و بررسی اثر تغییرات نرخ ارز بر صادرات و واردات محصولات کشاورزی می توان به مطالعات مشابه قبلی توجه نمود. هژبرکیانی و نیک اقبالی در تحقیق خود از الگوی نورالا سلام و سابرامانیان^۳ جهت بررسی اثر متغیرهای کمی موثر بر عرضه محصولات کشاورزی استفاده نمودند. آنها برای محاسبه متغیر انحراف نرخ واقعی ارز از مسیر تعادلی بلند مدت آن از الگوی کتانی، کاوالو و خان^۴ و برای محاسبه شاخص بی ثباتی نرخ واقعی ارز از الگوی پری و اشتاینر^۵ استفاده کردند.

در تحقیقی دیگر با عنوان نرخ ارز و نوسانات آن تا چه حد تجارت را تحت تاثیر قرار می دهد؟ بوردون و گرینک^۶ با استفاده از الگوی خود توضیح دهنده با وقفه های توزیع شده^۷، تاثیر تغییرات نرخ ارز بر صادرات و واردات سه منطقه شامل چین، ایالات متحده امریکا و منطقه یورو را مورد بررسی قرار دادند. با توجه به نمونه های بالا و مقایسه بین الگوهای مختلف، در پژوهش حاضر برای تخمین الگوی (ARDL) انتخاب شده است. به این منظور برای تعیین و تخمین تاثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات و

³ N.Islam & Subramanian 1989

⁴ J.A.Cottani ,F.D.Cavallo & Khan's 1990

⁵ A.Pree & Stienher 1989

⁶ Huchet Bourdon ,M & J.Korinek 2011

⁷ ARDL

واردات محصولات کشاورزی، ابتدا نوسانات را به دو بخش تکانه‌های مثبت و منفی نرخ ارز تقسیم کرده، سپس برای هر یک از متغیرهای صادرات و واردات یک تابع جداگانه تشکیل می‌دهیم.

$$X_a = \alpha_0 + \alpha_1 e + \alpha_2 \text{pos} + \alpha_3 \text{neg} + \varepsilon_1 \quad 1-1$$

$$M_a = \beta_0 + \beta_1 e + \beta_2 \text{pos} + \beta_3 \text{neg} + \varepsilon_2 \quad 2-1$$

در الگوی فوق X_a عرصه‌ی صادرات بخش کشاورزی، M_a تقاضای واردات بخش کشاورزی، e نرخ ارز اسمی، pos تکانه‌های مثبت نرخ ارز، neg تکانه‌های منفی نرخ ارز و ε_1 و ε_2 جملات پسماند الگو هستند.

۱-۲ تعریف مفاهیم

نرخ ارز: عبارت است از مقدار واحدهای پول ملی که برای بدست آوردن یک واحد پول خارجی باید پرداخت شود. (شاگری ص ۳۶۵)

نظام ارزی: به ترتیباتی که برای بازپرداخت وجوه و تعیین نرخ ارز میان گروهی از کشورها وجود دارد، نظام ارزی گفته می‌شود. تعیین نرخ ارز در همه اقتصادها مبتنی بر ساز و کار بازار است و عوامل عرضه و تقاضا نرخ ارز را تعیین می‌کنند و مقامات پولی از طریق ذخایر ارزی، برخی اوقات در بازار دخالت نموده و نرخ ارز را تحت تأثیر قرار می‌دهند. (محمدی ۱۳۸۵)

صادرات: صادرات عبارت است از کالاها و خدماتی که در داخل یک کشور تولید می‌شود و در خارج از آن کشور به فروش می‌رسد. (علوی ۱۳۹۳)

واردات: واردات عبارت است از کالاها و خدماتی که در خارج از کشور تولید می‌شود و در بازار داخلی به مصرف می‌رسد. (علوی ۱۳۹۳)