

بنام خداوند بخشنده مهربان



پایان نامه کارشناسی ارشد در رشته مهندسی کشاورزی گرایش اقتصاد کشاورزی

عنوان:

تأثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات کشمش ایران

استاد راهنما:

دکتر احمد اکبری

استاد مشاور:

دکتر مصیب پهلوانی

تحقیق و نگارش:

سونیا محبی موشایی

بهمن ۱۳۹۲

بسمه تعالی

این پایان نامه با عنوان تأثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات کشمش ایران، قسمتی از برنامه آموزشی دوره کارشناسی ارشد مهندسی کشاورزی-اقتصاد کشاورزی توسط دانشجو سونا محبی موشایی با راهنمایی استاد پایان نامه دکتر احمد اکبری تهیه شده است. استفاده از مطالب آن به منظور اهداف آموزشی با ذکر مرجع و اطلاع کتبی به حوزه تحصیلات تکمیلی دانشگاه سیستان و بلوچستان مجاز می باشد.

سونا محبی موشایی

این پایان نامه ۶ واحد درسی شناخته می شود و در تاریخ ۱۳۹۲/۱۱/۲۹ توسط هیئت داوران بررسی و درجه عالی به آن تعلق گرفت.

نام و نام خانوادگی	امضاء	تاریخ
استاد راهنما: دکتر احمد اکبری		
استاد راهنما:		
استاد مشاور: دکتر مصیب پهلوانی		
داور ۱: دکتر شهرکی		
داور ۲: دکتر یعقوبی		
نماینده تحصیلات تکمیلی:		



تعهدنامه اصالت اثر

اینجانب سونا محبی موشایی تعهد می‌کنم که مطالب مندرج در این پایان‌نامه حاصل کار پژوهشی اینجانب است و به دستاوردهای پژوهشی دیگران که در این نوشته از آن استفاده شده است مطابق مقررات ارجاع گردیده است. این پایان‌نامه پیش از این برای احراز هیچ مدرک هم سطح یا بالاتر ارائه نشده است.

کلیه حقوق مادی و معنوی این اثر متعلق به دانشگاه سیستان و بلوچستان می‌باشد.

نام و نام خانوادگی دانشجو: سونا محبی موشایی

امضاء

تقدیم بہ:

اولین و عزیزترین مہبت الہی، پدرم

و فرشتہ جاودان زندگی ام، مادرم

آنان کہ در سایہ دخت پر بار وجودشان آسایش و از ریشہ آن ہا شاخ و برگ گرفتہ ام و در سایہ وجودشان در راہ کسب علم و دانش تلاش نمودہ ام.

بودشان تاج افتخاری است بر سرم و نامشان دلیلی است بر بودنم چرا کہ این دو وجود پس از پروردگاریہ

ہستی ام بودہ اند،

دستم را گرفتہ و راہ رفتن را در این وادی زندگی پر از فراز و نشیب آموختہ اند.

و تقدیم بہ

یگانہ خواہر عزیزتر از جانم

و مادر بزرگم او کہ وجودش سراسر مہر بود.

روحش ساد

سپاسگزاری

سپاس خدای را

که اول است و پیش از او اولی نبوده و آخر است و پس از او آخری نباشد. خدایی که دیده‌های بینندگان از دیدنش ناتوانند و اندیشه‌های وصف کنندگان از عهده وصفش برنیایند.

اکنون که زمان سپاسگزاری فراهم شده بر خود لازم می‌دانم که از همه‌ی عزیزانی که همراه و همگام لحظاتم بودند نهایت تشکر را داشته باشم.

از استاد راهنمای بزرگواریم جناب آقای دکتر احمد اکبری که بزرگواری و صبورانه با مساعدت‌های بی‌دریغ خویش، راه گشای انجام تحقیق شدند، کمال تشکر را دارم. همچنین از راهنمایی‌های استاد محترم مشاور جناب آقای دکتر مصیب پهلوانی که با نظرات سازنده خویش باعث غنی‌تر شدن پژوهش حاضر گردیدند، نهایت قدردانی را می‌نمایم.

در پایان از دوستانم، مهتری احمدی‌جاوید، سمیه عوض‌دهنه و سمانه جعفری‌چاشمی که تحمل سختی‌ها و دشواری‌های این راه ناهموار را برایم آسان کردند و همواره در کنارم بودند تشکر می‌نمایم.

چکیده:

نوسانات نرخ ارز یکی از عوامل تأثیرگذار و درعین حال ابهام‌آمیز بر صادرات محصولات کشاورزی است. با توجه به اهمیت تجارت محصولات کشاورزی برای رهایی از اقتصاد تک محصولی، هدف از این مطالعه بررسی اثر نوسانات نرخ ارز واقعی بر صادرات کشمش ایران طی دوره ۱۳۳۸-۱۳۹۰ است. در ابتدا با استفاده از داده‌های سالیانه، نرخ ارز واقعی و نوسانات نرخ ارز محاسبه شده و رفتار صادرات کشمش با به‌کارگیری الگوی VECM مورد ارزیابی قرار گرفته است. نتایج نشان داد در بلندمدت و کوتاه‌مدت بین صادرات کشمش و متغیرهای اصلی آن (میانگین وزنی درآمد ناخالص واردکنندگان، قیمت عمده فروشی، نرخ ارز واقعی، ارزش افزوده بخش کشاورزی) رابطه معنی‌داری وجود دارد؛ به طوری که مطابق با تئوری با نوسانات نرخ ارز رابطه معکوس دارد.

ضریب مربوط به جمله تصحیح خطا (ECM(-1) معنی‌دار و علامت آن مطابق انتظار منفی بود. مقدار ضریب برابر ۰/۲۰- به دست آمد و بیانگر این است که حدود ۲۰ درصد از عدم تعادل صادرات کشمش از مقادیر بلندمدت خود، بعد از سپری شدن یک دوره از بین خواهد رفت. نتایج تابع واکنش آنی بیان کرد که پس از ۱۴ سال اثر شوک وارده از سمت نوسانات نرخ ارز واقعی مضمحل شده و صادرات کشمش در ۱۸٪ پایین‌تر از سطح تعادل اولیه پایدار می‌شود.

کلمات کلیدی: کشمش، نوسانات نرخ ارز، VECM، تابع واکنش آنی.

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول: کلیات تحقیق.....
۲	۱-۱- مقدمه
۳	۲-۱- تعریف مسئله و بیان سؤال‌های اصلی تحقیق.....
۴	۳-۱- ضرورت و سابقه انجام تحقیق.....
۷	۴-۱- فرضیات تحقیق.....
۷	۵-۱- اهداف تحقیق.....
۷	۶-۱- کاربردهای تحقیق.....
۸	۷-۱- استفاده‌کنندگان از نتایج تحقیق.....
۸	۸-۱- نوآوری تحقیق.....
۹	۹-۱- روش انجام تحقیق.....
۹	۱۰-۱- روش و ابزار گردآوری اطلاعات.....
۹	۱۱-۱- روش تجزیه و تحلیل اطلاعات.....
۹	۱۲-۱- محدودیت‌های تحقیق.....
۱۰	فصل دوم: مبانی نظری و پیشینه تحقیق.....
۱۱	۱-۲- مقدمه.....
۱۱	۲-۲- بخش اول: مفاهیم و مبانی نظری.....
۱۱	۲-۲-۱- اهمیت تجارت بین‌الملل و نقش آن در رشد و توسعه اقتصادی
۱۲	۲-۲-۲- نگاهی به مزیت نسبی در بخش کشاورزی ایران
۱۲	۳-۲-۲- مفهوم نرخ ارز
۱۴	۴-۲-۲- نرخ ارز اسمی و نرخ ارز واقعی
۱۵	۵-۲-۲- نوسانات نرخ ارز واقعی و تأثیر آن بر صادرات.....
۱۷	۶-۲-۲- ادبیات اقتصادی گذر نرخ ارز.....
۱۸	۷-۲-۲- پیشینه و چگونگی تعیین نرخ ارز در ایران.....
۱۸	۲-۲-۷-۱- قبل از پیروزی انقلاب اسلامی (۱۳۳۶-۱۳۵۷).....
۱۹	۲-۲-۷-۲- پس از پیروزی انقلاب اسلامی (۱۳۵۸-۱۳۹۰).....
۲۳	۸-۲-۲- الگوهای عرضه صادرات.....
۲۵	۳-۲- بخش دوم: پیشینه تحقیق
۲۵	۱-۳-۲- مطالعات انجام‌شده در داخل کشور.....
۳۵	۲-۳-۲- مطالعات انجام‌شده در خارج از کشور.....
۴۴	۴-۲- بخش سوم.....
۴۴	۱-۴-۲- گیاه‌شناسی انگور و کشمش.....
۴۵	۲-۴-۲- مهم‌ترین ارقام انگور برای تولید کشمش در ایران.....

۴۶۲-۴-۳- بررسی وضعیت انگور و کشمش در ایران و جهان
۴۶۲-۴-۳-۱- سطح زیر کشت انگور در ایران
۴۸۲-۴-۳-۲- سطح زیر کشت انگور در جهان
۴۹۲-۴-۳-۳- تولید انگور و کشمش در ایران
۵۱۲-۴-۳-۴- تولید انگور و کشمش در جهان
۵۲۲-۴-۴- بررسی تجارت جهانی کشمش
۵۲۲-۴-۴-۱- صادرات کشمش ایران
۵۳۲-۴-۴-۲- صادرات جهانی کشمش
۵۴۲-۴-۴-۳- ارزش صادرات کشمش
۵۴۲-۴-۴-۴- واردات جهانی کشمش از ایران
۵۵۲-۵- خلاصه و جمع بندی
۵۷ فصل سوم: روش شناسی تحقیق
۵۸۳-۱- مقدمه
۵۸۳-۲- روش های اندازه گیری نرخ ارز واقعی
۵۹۳-۳- معرفی الگوی سری زمانی نرخ ارز واقعی متناسب با ساختار اقتصادی ایران
۶۰۳-۴- شاخص نوسان پذیری نرخ ارز
۶۰۳-۵- آزمون ریشه واحد: آزمون برای مانا بودن
۶۱۳-۶- آزمون های شکست ساختاری
۶۱۳-۶-۱- آزمون فیلیپس پرون
۶۲۳-۶-۲- آزمون زیوت- اندروز
۶۳۳-۷- مدل سازی خود رگرسیونی برداری (VAR)
۶۴۳-۸- هم انباشتگی
۶۵۳-۹- تابع عکس العمل تحریک
۶۶۳-۱۰- آزمون واریانس ناهمسانی و خود همبستگی مدل
۶۶۳-۱۱- خلاصه و جمع بندی
۶۷ فصل چهارم: تصریح و برآورد مدل
۶۸۴-۱- مقدمه
۶۸۴-۲- مدل سازی VAR برای صادرات کشمش ایران
۷۵۴-۳- آزمون واریانس ناهمسانی و خود همبستگی مدل
۷۶۴-۴- خلاصه و جمع بندی
۷۸ فصل پنجم: جمع بندی، نتیجه گیری و ارائه پیشنهادات
۷۹۵-۱- جمع بندی نتایج
۷۹۵-۲- بررسی فرضیات تحقیق
۸۰۵-۳- پاسخ سؤالات تحقیق
۸۰۵-۴- توصیه های سیاستی در زمینه افزایش صادرات کشمش
۸۳۵-۵- پیشنهادات برای تحقیقات آتی
۸۴ فهرست منابع تحقیق

۸۴ الف: منابع فارسی
۸۹ ب: منابع انگلیسی
۹۱ پیوست

فهرست جدول‌ها

شماره و عنوان جدول	صفحه
۱-۲. خلاصه مطالعات انجام‌شده در ارتباط با نوسانات نرخ ارز و سطح تجارت در داخل کشور	۴۳
۲-۲. خلاصه مطالعات انجام‌شده در ارتباط با نوسانات نرخ ارز و سطح تجارت در خارج از کشور.....	۴۴
۳-۲. خصوصیات ارقام مختلف انگور قابل کشت در ایران برای تولید کشمش.....	۴۶
۴-۲. سطح زیر کشت انگور در کشور به تفکیک استان در سال ۱۳۸۹.....	۴۷
۵-۲. سطح زیر کشت انگور ایران و کشورهای منتخب طی دوره زمانی ۲۰۰۵-۲۰۱۰.....	۴۸
۶-۲. میزان تولید انگور و کشمش در کشور به تفکیک استان در سال ۱۳۸۹.....	۵۰
۷-۲. میزان تولید انگور ایران و کشورهای منتخب طی دوره زمانی ۲۰۰۵-۲۰۱۰.....	۵۲
۸-۲. میزان صادرات کشمش ایران و کشورهای منتخب طی دوره زمانی ۲۰۰۵-۲۰۱۰.....	۵۳
۹-۲. ارزش صادرات کشمش ایران و کشورهای منتخب طی دوره زمانی ۲۰۰۵-۲۰۱۰.....	۵۴
۱۰-۲. عمده‌ترین واردکنندگان کشمش ایران طی دوره زمانی ۲۰۰۵-۲۰۱۰.....	۵۵
۱-۴. نتایج آزمون ریشه واحد زیوت اندروز (ZA)	۶۹
۲-۴. نتایج آزمون ریشه واحد فیلیپس - پرون (PP)	۶۹
۳-۴. نتایج حاصل از تعیین وقفه بهینه	۷۰
۴-۴. نتایج آزمون اثر (λ_{Trace}) برای تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشتگی.....	۷۱
۵-۴. نتایج آزمون مقادیر ویژه (λ_{Max}) برای تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشتگی.....	۷۱
۶-۴. نتایج برآورد مدل VECM نامقید.....	۷۱
۷-۴. نتایج برآورد ضرایب تعدیل.....	۷۲
۸-۴. آزمون واریانس ناهمسانی.....	۷۵
۹-۴. آزمون خود همبستگی.....	۷۶

فهرست نمودارها

شماره و عنوان نمودار	صفحه
۱-۱. میزان صادرات کشمش ایران طی سال‌های ۱۳۳۸-۱۳۹۰.....	۴
۱-۲. روند نرخ ارز اسمی و نرخ ارز واقعی ایران طی دوره ۱۳۳۸-۱۳۹۰.....	۲۲
۲-۲. توزیع سطح بارور انگور استان‌ها نسبت به کل کشور در سال ۱۳۸۹.....	۴۷
۲-۳. توزیع سطح زیر کشت انگور در کشورهای مختلف نسبت به کل جهان در سال ۲۰۱۰.....	۴۸
۲-۴. توزیع میزان تولید انگور استان‌ها نسبت به کل کشور در سال ۱۳۸۹.....	۵۰
۲-۵. سهم کشورهای مختلف در تولید انگور در سال ۲۰۱۰.....	۵۱
۴-۱. پاسخ صادرات کشمش به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر نوسانات نرخ ارز واقعی.....	۷۲
۴-۲. پاسخ صادرات کشمش به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر درآمد ناخالص واردکنندگان	۷۳
۴-۳. پاسخ صادرات کشمش به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر قیمت عمده فروشی کشمش.	۷۴
۴-۴. پاسخ صادرات کشمش به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر نرخ ارز واقعی.....	۷۴
۴-۵. پاسخ صادرات کشمش به شوک مثبت وارده به اندازه یک انحراف معیار بر ارزش افزوده بخش کشاورزی	۷۵

فهرست پیوست

صفحه	پیوست
۹۱	پیوست (الف): نتایج آزمون ریشه واحد زیوت-اندروز (ZA) روی صادرات کشمش.....
۹۲	پیوست (ب): نتایج آزمون ریشه واحد زیوت-اندروز (ZA) روی درآمد ناخالص واردکنندگان کشمش..
۹۳	پیوست (پ): نتایج آزمون ریشه واحد زیوت-اندروز (ZA) روی قیمت عمده فروشی کشمش.....
۹۴	پیوست (ت): نتایج آزمون ریشه واحد زیوت-اندروز (ZA) روی نرخ ارز واقعی ایران.....
۹۵	پیوست (ث): نتایج آزمون ریشه واحد زیوت-اندروز (ZA) روی ارزش افزوده بخش کشاورزی.....
۹۶	پیوست (ج): نتایج آزمون ریشه واحد زیوت-اندروز (ZA) روی نوسانات نرخ ارز واقعی ایران.....
۹۷	پیوست (چ): نتایج آزمون ریشه واحد فیلیپس- پرون روی صادرات کشمش ایران.....
۹۷	پیوست (ح): نتایج آزمون ریشه واحد فیلیپس- پرون روی درآمد ناخالص واردکنندگان کشمش ایران
۹۷	پیوست (خ): نتایج آزمون ریشه واحد فیلیپس- پرون روی قیمت عمده فروشی کشمش ایران.....
۹۸	پیوست (د): نتایج آزمون ریشه واحد فیلیپس- پرون روی نرخ ارز واقعی ایران.....
۹۸	پیوست (ذ): نتایج آزمون ریشه واحد فیلیپس- پرون روی ارزش افزوده بخش کشاورزی.....
۹۸	پیوست (ر): نتایج آزمون فیلیپس-پرون روی نوسانات نرخ ارز واقعی ایران.....
۹۹	پیوست (ز): تعیین وقفه بهینه مدل VAR.....
۹۹	پیوست (ژ): تعیین تعداد بردارهای هم انباشتگی با استفاده از λ_{Trace} و λ_{Max}
۱۰۲	پیوست (س): نتایج تخمین مدل VECM نامقید.....
۱۰۴	پیوست (ش): بررسی ناهمسانی در مدل.....
۱۰۴	پیوست (ص): بررسی خود همبستگی در مدل.....

فهرست علائم

نشانه	علامت
ارزش صادرات کشمش ایران	EV
میانگین وزنی درآمد ناخالص واردکنندگان کشمش ایران	FI
قیمت عمده‌فروشی کشمش ایران	WP
نرخ ارز واقعی ایران	RER
ارزش افزوده بخش کشاورزی ایران	AVA
نوسانات نرخ ارز واقعی	LH

فصل اول

کلیات تحقیق

کشاورزی یکی از ارکان پیشرفت و توسعه اقتصادی در بسیاری از کشورهای جهان به شمار می‌رود. در ایران نیز به دلیل وجود طبیعت چهار فصل و تنوع آب و هوایی، زمین‌های مستعد کشاورزی و نیروی کار جوان و ارزان قیمت، بخش کشاورزی از مهم‌ترین بخش‌های فعال و مولد در اقتصاد به شمار می‌رود. همچنین با توجه به اینکه طی سال‌های اخیر نفت همواره یکی از اقلام عمده صادراتی کشور بوده و نوسانات قیمت آن تأثیر شدیدی بر وضعیت کشور گذاشته است، اهمیت بخش کشاورزی در اقتصاد کشور و ضرورت پرداختن به بحث صادرات محصولات کشاورزی جهت توسعه صادرات غیر نفتی و رهایی از اقتصاد تک محصولی بیش از پیش آشکار می‌شود. هر چند که ایران از دیرباز در برخی محصولات کشاورزی از پتانسیل‌های قوی صادراتی برخوردار بوده، اما با گذشت زمان نتوانسته همگام با تحولات جهانی پیش برود و از جایگاه شایسته‌ای برخوردار شود و یا حداقل وضعیت قبلی خود را حفظ کند. از جمله این محصولات می‌توان به کشمش اشاره نمود، به گونه‌ای که طبق آمار فائو، ایران از رتبه دوم در سال ۲۰۰۵ به رتبه سوم در سال ۲۰۱۰ رسیده است. لذا با توجه به این شرایط، بررسی عوامل اثرگذار بر صادرات محصولات کشاورزی از جمله نوسانات نرخ ارز واقعی می‌تواند اطلاعات سودمندی در زمینه تدوین راهبرد توسعه در اختیار برنامه‌ریزان و سیاست‌گذاران قرار دهد.

در این فصل همچون روال معمول سایر پایان‌نامه‌ها کلیاتی از موضوع مورد مطالعه بیان شده است. مهم‌ترین بخش‌های این کلیات شامل بیان مسئله و سؤالات اصلی، سابقه و ضرورت انجام، فرضیات، اهداف و روش انجام تحقیق می‌باشد که هر یک در جای خود به تفصیل بیان خواهد شد. سایر بخش‌ها همچون کاربردها و نوآوری طرح، منابع آماری و اطلاعاتی و محدودیت‌های تحقیق نیز در ادامه مطالب این فصل بیان خواهد شد.

۲-۱- تعریف مسئله و بیان سؤال‌های اصلی تحقیق

صادرات کالا، بیانگر امکانات تولید کشور در رفع نیازهای بین‌المللی و فراهم آوردن ارز لازم برای تأمین واردات می‌باشد. تأمین نیازهای ارزی از طریق فروش ثروت‌های ملی، به ویژه درآمدهای حاصل از فروش نفت، به بی‌ثباتی اقتصاد داخلی، وابستگی اقتصادی، سیاسی و اجتماعی منجر می‌شود؛ زیرا با وابستگی نسبی اقتصاد به یک کالای خاص، اقتصاد کشور نیز از روند صادرات آن کالا پیروی نموده و با نوسانات قیمت آن دچار آشفتگی می‌گردد؛ بنابراین برای برون‌رفت از اقتصاد تک محصولی وابسته به درآمدهای حاصل از صدور نفت خام، با عنایت به وجود توانایی‌های مناسب تولید کالاهای غیر نفتی به ویژه در بخش کشاورزی، زمینه افزایش درآمدهای ارزی از طریق گسترش صادرات در این بخش وجود دارد (محمود زاده و زیبایی، ۱۳۸۳).

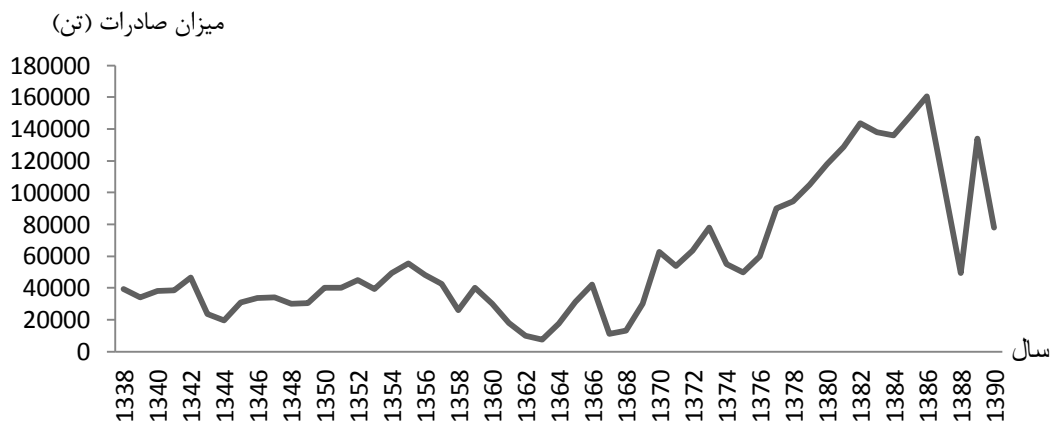
یکی از مهم‌ترین بخش‌های اقتصادی در کشورهای در حال توسعه، بخش کشاورزی می‌باشد. این بخش علاوه بر تأمین امنیت غذایی، نقش مؤثری در توسعه اقتصادی، اشتغال و صادرات غیر نفتی کشور دارد. ایران نیز از این قاعده مستثنی نبوده و بخش کشاورزی در این کشور از اهمیت خاصی برخوردار می‌باشد و همواره نقش چشمگیری در صادرات غیر نفتی داشته است اما از آنجا که صادرات محصولات کشاورزی به طور جدی و مناسب مورد توجه قرار نگرفته و به شکل بهینه‌ای تحت برنامه‌ریزی مدون قرار نداشته، نتیجه مطلوبی در روند توسعه اقتصادی کشور به دست نداده و صادرات این بخش همواره با بحران‌های متعددی مواجه بوده است (جولایی و کاظم نژاد، ۱۳۹۰).

در میان محصولات صادراتی بخش کشاورزی، کشمش از اهمیت ویژه‌ای برخوردار می‌باشد چرا که ایران با دارا بودن حدود ۲۱ درصد از سهم بازار جهانی کشمش یکی از بزرگ‌ترین صادرکنندگان این محصول در سطح جهانی است و بدین ترتیب می‌تواند در تعیین قیمت این محصول در بازار جهانی نقش مؤثری داشته باشد و با کم‌ترین تغییر در قیمت کشمش صادراتی ایران در بازار جهانی امکان تحت تأثیر قرار گرفتن سهم ایران از بازار جهانی این محصول وجود دارد (حقیقت و حسین پور، ۱۳۸۹). طبق آمار فائو^۱ ایران با صادرات کشمش به ارزش ۹۰۵۹۷ دلار و مقدار ۱۳۶۱۹۸ تن در سال ۲۰۰۵ در جایگاه دوم قرار داشت؛ اما به تدریج این جایگاه را از دست داد و در سال ۲۰۱۰ با صادرات این محصول به ارزش ۳۱۸۸۷۹ دلار و مقدار ۱۳۴۰۵۹ تن در جایگاه سوم قرار گرفت. شش کشور عمده صادرکننده کشمش در جهان به ترتیب ترکیه، آمریکا، ایران، شیلی، آفریقای

1. Food and Agriculture Organization

جنوبی، یونان می‌باشند که در سال ۲۰۱۰ به طور میانگین ۸۳ درصد صادرات جهانی به این کشورها اختصاص داشته و سهم ایران در صادرات این محصول ۱۸ درصد بوده است.

نمودار (۱-۱) روند صادرات کشمش ایران را نشان می‌دهد. همانطور در این نمودار مشاهده می‌شود، میزان صادرات ایران در سال ۱۳۸۸ مقدار ۴۹۳۲۴ تن می‌باشد که نسبت به سال ۱۳۸۷ که میزان ۱۰۴۳۴۹ تن بوده است کاهش چشمگیری داشته است.



نمودار ۱-۱. میزان صادرات کشمش ایران طی سال‌های ۱۳۳۸-۱۳۹۰

از این رو سیاست‌گذاران و برنامه‌ریزان می‌توانند با اتخاذ سیاست‌ها و تصمیم‌گیری‌های مناسب در زمینه صادرات کشمش زمینه گسترش تجارت جهانی این محصول را فراهم آورند. از این جهت بررسی تأثیر نوسانات نرخ ارز به عنوان یکی از مهم‌ترین عوامل مؤثر بر میزان صادرات این محصول می‌تواند به سیاست‌گذاران جهت تصمیم‌گیری‌های دقیق‌تر و مؤثرتر کمک نماید، همچنین باعث می‌شود تا فرایند تصمیم‌گیری به نحو مناسب‌تری صورت پذیرد. لذا مطالعه حاضر کوششی در جهت بررسی این موضوع می‌باشد. با توجه به مطالب گفته‌شده سؤالات زیر مورد بررسی قرار می‌گیرد.

۱- تأثیر نوسانات نرخ ارز بر ارزش صادرات کشمش در کوتاه مدت و بلندمدت به چه میزان می‌باشد؟

۲- آیا قیمت عمده فروشی بر ارزش صادرات کشمش تأثیر معنی داری دارد؟

۳-۱- ضرورت و سابقه انجام تحقیق

در رابطه با ضرورت انجام تحقیق می‌توان بیان نمود که با توجه به نوسانات در سال‌های پس از انقلاب در اثر قطع صادرات ایران به آمریکا، پیچیده شدن اقتصاد جهانی و پیوستن اغلب کشورها به سازمان تجارت جهانی موقعیت ایران در صادرات محصولات کشاورزی از جمله کشمش ضعیف شد. کاهش سهم ایران در

صادرات جهانی کشمش و افزایش سهم رقبای تجاری آن طی سال‌های اخیر، ضرورت بررسی عوامل و متغیرهای تأثیرگذار بر صادرات این محصول را نمایان می‌سازد. نرخ ارز یکی از عوامل تأثیرگذار و درعین حال ابهام‌آمیز بر صادرات محصولات کشاورزی است. در طی سال‌های گذشته، برنامه‌هایی به منظور متعادل ساختن اقتصاد و برقراری محیط باثبات اقتصادی آغاز شد، به عنوان مثال دولت برای برقراری نرخ واقعی ارز اقدام به چند نرخی کردن ارز کرده و سپس برای تک نرخی کردن ارز اقدام ورزید. متعاقب این اقدام، نوسانات نرخ ارز که همواره شدید بوده به نحو عمده‌ای کاهش یافته است، این سیاست همراه با دخالت‌های مستقیم دولت و اجرای سیاست‌های بازتر در مورد صادرات محصولات کشاورزی، زمینه را برای افزایش درآمد تولیدکنندگان محصولات صادراتی فراهم ساخته است. هرچند که عدم وجود نظام بازاریابی کارا، منافع حاصل از این سیاست را تا حدود زیادی کاهش داده است؛ اما با تقویت بخش کشاورزی می‌توان دریافتی‌های ارزی حاصل از صدور این محصولات را به طور قابل توجهی افزایش داد. لازمه‌ی شکل‌گیری یک بخش قوی در درازمدت، اتخاذ سیاست‌های مناسبی است که بدون شناسایی و تشخیص عوامل مؤثر نمی‌تواند عملی شود (خلیلیان و فرهادی، ۱۳۸۱).

با توجه به اهمیت تجارت محصولات کشاورزی برای رهایی از اقتصاد تک محصولی و به دلیل اینکه کشمش بعد از پسته، دومین قلم صادراتی مهم در زیر بخش کشاورزی ایران به شمار می‌رود و نیز به دلیل افزایش قابل ملاحظه‌ی تجارت خارجی کشورهای جهان، باعث شده است که محققین زیادی به بررسی تأثیرگذاری نوسانات نرخ ارز بر روی تجارت خارجی بپردازند؛ بنابراین با توجه به پتانسیل بالقوه و بالفعل کشور در تولید محصولات کشاورزی، برای تقویت و افزایش صادرات این بخش و لزوم برنامه‌ریزی مناسب صادرات، بررسی تأثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات، از جمله کشمش ضروری است.

از جمله مطالعاتی که در ایران و خارج از کشور در زمینه بررسی اثرات نرخ ارز صورت گرفته است می‌توان به موارد زیر اشاره نمود:

فرخ زاده (۱۳۸۶) طی مطالعه‌ای باهدف تعیین نقش عوامل مؤثر بر صادرات محصولات باغی شامل بادام، خرما، سیب، با استفاده از روش ARDL نقش عوامل یادشده را در بلندمدت و کوتاه‌مدت برای سال‌های ۱۳۶۲ - ۱۳۸۳ مورد ارزیابی قرار داد. بر اساس نتایج حاصل، در بلندمدت متغیر تولید داخلی و نسبت قیمت جهانی به قیمت داخلی اثر مثبت و معنی‌داری بر عرضه صادرات بادام دارند. درحالی‌که نرخ ارز در درازمدت اثر منفی، اما فاقد اهمیت آماری بر روند صادرات بادام دارد. در کوتاه‌مدت نیز تنها متغیر تولید داخلی می‌تواند صادرات

بادام را تحت تأثیر قرار دهد. صادرات محصول خرما در کوتاه‌مدت و بلندمدت تحت تأثیر نسبت قیمت جهانی به قیمت داخلی و نرخ ارز می‌باشد که متغیر قیمت اثر مثبت و نرخ ارز اثر منفی دارد، اما تولید داخلی اثر معنی‌داری بر صادرات آن دارند. صادرات سیب در درازمدت تنها متأثر از تولید داخلی بوده، ولی اثر متغیرهای مورد استفاده در کوتاه‌مدت بر صادرات این محصول معنی‌دار نیست. در مورد همه محصولات مورد مطالعه در بلندمدت، نرخ ارز اثر معنی‌داری بر صادرات نداشته است.

رستمی و احمدلو (۱۳۸۹) به بررسی تأثیر تکنه‌های نرخ ارز واقعی بر میزان صادرات و واردات در ایران (۱۳۴۰-۱۳۸۷) پرداختند. برای این منظور، در مرحله اول با استفاده از فیلتر هودریک - پرسکات، تکنه‌ها را به صورت تکنه‌های پیش‌بینی‌شده و پیش‌بینی‌نشده نرخ ارز و تکنه‌های مثبت و منفی نرخ ارز تجزیه کرده و در مرحله بعد آن‌ها را بر روی صادرات و واردات برآورده نموده‌اند. نتایج برآورد، نشان‌دهنده اثرات نامتقارن تکنه‌های نرخ ارز بر صادرات و واردات می‌باشد، به طوری که تکنه‌های پیش‌بینی‌شده و پیش‌بینی‌نشده نرخ ارز به صورت متفاوت از هم بر روی صادرات تأثیر می‌گذارد؛ بدین صورت که تکنه‌های پیش‌بینی‌شده نرخ ارز بیش‌تر از تکنه‌های پیش‌بینی‌نشده آن، صادرات را دچار نوسان می‌کند. همچنین این تکنه‌ها بر روی واردات نیز به طور متفاوت از هم تأثیرگذار می‌باشند، به طوری که تکنه‌های پیش‌بینی‌نشده نرخ ارز نسبت به تکنه‌های پیش‌بینی‌شده، اثرات به مراتب بیش‌تری بر روی واردات دارد. نتایج این تحقیق نشان می‌دهد که تکنه‌های منفی نرخ ارز بیش‌تر از تکنه‌های مثبت نرخ ارز صادرات را تحت تأثیر قرار می‌دهد، ولی در مورد واردات عکس این حالت صادق است.

ورگیل^۱ (۲۰۰۲) در یک مقاله تجربی به بررسی تأثیر نوسانات نرخ ارز واقعی بر جریان تجاری در صادرات ترکیه به ایالات متحده و سه تن از بزرگ‌ترین شرکای تجاری در اتحادیه اروپا برای دوره زمانی ۱۹۹۰-۲۰۰۰ با استفاده از مدل‌های هم‌انباشتگی و تصحیح خطا پرداخته است. نتایج به دست آمده حاکی از آن است که نوسانات نرخ ارز واقعی دارای یک اثر منفی قابل‌توجهی بر صادرات می‌باشد.

سکانتسی^۲ (۲۰۱۱) به بررسی اثر نوسانات نرخ ارز واقعی بر صادرات آفریقای جنوبی به ایالات متحده طی دور زمانی ۱۹۹۵-۲۰۰۷ پرداخته است. وی برای اندازه‌گیری نوسانات نرخ ارز واقعی مدل GARCH را مورد استفاده قرار داده است. پس از اثبات وجود هم‌انباشتگی در میان متغیرهای درگیر در مدل صادراتی دو کشور،

1. Vergil, H.
2. Sekantsi, L.P.