

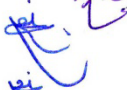




بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

تایید اعضای هیأت داوران حاضر در جلسه دفاع از پایان نامه کارشناسی ارشد

اعضای هیأت داوران نسخه ی نهائی پایان نامه خانم ...کبری حسنی دیزجی..... تحت عنوان : بررسی تأثیر نوسانات نرخ ارز بر تجارت محصولات کشاورزی را از نظر فرم و محتوی بررسی نموده و پذیرش آن را برای تکمیل درجه کارشناسی ارشد پیشنهاد می کنند:

امضاء	رتبه ی علمی	نام و نام خانوادگی	اعضای هیأت داوران
	دانشیار	آقای دکتر صادق خلیلیان	۱- استاد راهنما
	استادیار	آقای دکتر سید ابوالقاسم مرتضوی	۲- استاد مشاور
	استادیار	آقای دکتر عنایت عباسی	۳- نماینده شورای تحصیلات تکمیلی
	استادیار	آقای دکتر عنایت عباسی	۴- اساتید ناظر: ۱- داخلی
	استادیار	آقای دکتر مجید احمدیان	۲- خارجی

## آیین نامه حق مالکیت مادی و معنوی در مورد نتایج پژوهشهای علمی دانشگاه تربیت مدرس

مقدمه: با عنایت به سیاست‌های پژوهشی و فناوری دانشگاه در راستای تحقق عدالت و کرامت انسانها که لازمه شکوفایی علمی و فنی است و رعایت حقوق مادی و معنوی دانشگاه و پژوهشگران، لازم است اعضای هیأت علمی، دانشجویان، دانش‌آموختگان و دیگر همکاران طرح، در مورد نتایج پژوهشهای علمی که تحت عناوین پایان‌نامه، رساله و طرحهای تحقیقاتی با هماهنگی دانشگاه انجام شده است، موارد زیر را رعایت نمایند:

ماده ۱- حق نشر و تکثیر پایان‌نامه/ رساله و درآمدهای حاصل از آنها متعلق به دانشگاه می باشد ولی حقوق معنوی پدید آورندگان محفوظ خواهد بود.

ماده ۲- انتشار مقاله یا مقالات مستخرج از پایان‌نامه/ رساله به صورت چاپ در نشریات علمی و یا ارائه در مجامع علمی باید به نام دانشگاه بوده و با تایید استاد راهنمای اصلی، یکی از اساتید راهنما، مشاور و یا دانشجو مسئول مکاتبات مقاله باشد. ولی مسئولیت علمی مقاله مستخرج از پایان‌نامه و رساله به عهده اساتید راهنما و دانشجو می باشد.

تبصره: در مقالاتی که پس از دانش‌آموختگی بصورت ترکیبی از اطلاعات جدید و نتایج حاصل از پایان‌نامه/ رساله نیز منتشر می‌شود نیز باید نام دانشگاه درج شود.

ماده ۳- انتشار کتاب، نرم افزار و یا آثار ویژه (اثری هنری مانند فیلم، عکس، نقاشی و نمایشنامه) حاصل از نتایج پایان‌نامه/ رساله و تمامی طرحهای تحقیقاتی کلیه واحدهای دانشگاه اعم از دانشکده ها، مراکز تحقیقاتی، پژوهشکده ها، پارک علم و فناوری و دیگر واحدها باید با مجوز کتبی صادره از معاونت پژوهشی دانشگاه و براساس آئین نامه های مصوب انجام شود.

ماده ۴- ثبت اختراع و تدوین دانش فنی و یا ارائه یافته ها در جشنواره های ملی، منطقه ای و بین‌المللی که حاصل نتایج مستخرج از پایان‌نامه/ رساله و تمامی طرح های تحقیقاتی دانشگاه می باشد، باید با هماهنگی استاد راهنما یا مجری طرح از طریق معاونت پژوهشی دانشگاه انجام گیرد.

ماده ۵- این آیین‌نامه در ۵ ماده و یک تبصره در تاریخ ۸۷/۴/۱ در شورای پژوهشی و در تاریخ ۸۷/۴/۲۳ در هیأت رئیسه دانشگاه به تایید رسید و در جلسه مورخ ۸۷/۷/۱۵ شورای دانشگاه به تصویب رسیده و از تاریخ تصویب در شورای دانشگاه لازم‌الاجرا است.



بسمه تعالی

## آیین نامه چاپ پایان نامه (رساله) های دانشجویان دانشگاه تربیت مدرس

نظر به اینکه چاپ و انتشار پایان نامه (رساله) های تحصیلی دانشجویان دانشگاه تربیت مدرس، مبین بخشی از فعالیتهای علمی-پژوهشی دانشگاه است بنابراین به منظور آگاهی و رعایت حقوق دانشگاه، دانش آموختگان این دانشگاه نسبت به رعایت موارد ذیل متعهد می شوند:

ماده ۱ در صورت اقدام به چاپ پایان نامه (رساله)ی خود، مراتب را قبلاً به طور کتبی به دفتر نشر آثار علمی دانشگاه اطلاع دهد.

ماده ۲ در صفحه سوم کتاب (پس از برگ شناسنامه)، عبارت ذیل را چاپ کند:

“ کتاب حاضر، حاصل پایان نامه کارشناسی ارشد نگارنده در رشته اقتصاد کشاورزی است که در سال ۱۳۹۰ در دانشکده کشاورزی دانشگاه تربیت مدرس به راهنمایی جناب آقای دکتر صادق خلیلیان و مشاوره جناب آقای دکتر سید ابوالقاسم مرتضوی از آن دفاع شده است ”

ماده ۳ به منظور جبران بخشی از هزینه های انتشارات دانشگاه، تعداد یک درصد شمارگان کتاب (در هر نوبت چاپ) را به دفتر نشر آثار علمی دانشگاه اهدا کند. دانشگاه می تواند مازاد نیاز خود را به نفع مرکز نشر در معرض فروش قرار دهد.

ماده ۴ در صورت عدم رعایت ماده ۳، ۵۰٪ بهای شمارگان چاپ شده را به عنوان خسارت به دانشگاه تربیت مدرس، تأدیه کند.

ماده ۵ دانشجو تعهد و قبول می کند در صورت خودداری از پرداخت بهای خسارت دانشگاه می تواند خسارت مذکور را از طریق مراجع قضایی مطالبه و وصول کند، به علاوه به دانشگاه حق می دهد به منظور استیفای حقوق خود، از طریق دادگاه، معادل وجه مذکور در ماده ۴ را از محل توقیف کتابهای عرضه شده نگارنده برای فروش، تأمین نماید.

ماده ۶ اینجانب کبری حسنی دیزجی دانشجوی رشته اقتصاد کشاورزی مقطع کارشناسی ارشد تعهد فوق و ضمانت اجرایی آن را قبول کرده، به آن ملتزم می شوم.

نام و نام خانوادگی: کبری حسنی دیزجی

تاریخ و امضاء:



دانشگاه تربیت مدرس

دانشکده کشاورزی  
گروه اقتصاد کشاورزی

پایان نامه دوره کارشناسی ارشد مهندسی اقتصاد کشاورزی

**عنوان:**

**بررسی تأثیر نوسانات نرخ ارز بر تجارت  
محصولات منتخب کشاورزی و تراز تجاری بخش  
کشاورزی**

**نگارنده:**

کبری حسنی دیزجی

**استاد راهنما**

دکتر صادق خلیلیان

**استاد مشاور**

دکتر سید ابوالقاسم مرتضوی

بهمن ۱۳۹۰

تقدیم ہے:

پدر و مادر عزیزم

و خواہران مہربانم

بسمه تعالی

## تقدیر و تشکر:

اکنون که با یاری خداوند متعال این پایان نامه به پایان رسیده است، بر خود لازم می دانم از اساتید عزیز و گرانقدر جناب آقای دکتر صادق خلیلیان و جناب آقای دکتر سید ابوالقاسم مرتضوی و تمامی اساتیدی که مرا تا این مرحله یاری نموده اند تشکر و قدردانی نمایم. همچنین تشکر و امتنان قلبی خود را خدمت خانواده عزیزم که همیشه و در تمامی مراحل تحصیل بهترین مشوق و پشتیبان بنده بوده اند، تقدیم می نمایم. در نهایت از کلیه دوستانم و همه آنان که به نوعی در به ثمر رساندن این پژوهش علمی مرا یاری و مساعدت نمودند، کمال تشکر را دارم. برای همه عزیزان از ایزدمنان، توفیق، عزت و سربلندی آرزومندم.

## چکیده

پدیده جهانی شدن اقتصاد و از بین رفتن مرزهای تجاری کشورها، به شدت در حال شکل‌گیری است و در آینده‌ای نه چندان دور، کشورها به سختی قادر خواهند بود خود را از این جریان کنار کشیده و تنها در حاشیه نظاره‌گر تحولات تجاری بین کشورها باشند. از اینرو می‌توان گفت که تجارت نقش مهمی در اقتصاد کشورها دارد. از میان عوامل تاثیرگذار بر تجارت خارجی، می‌توان به نرخ ارز اشاره کرد. گذشته از تأثیر و اهمیت نرخ ارز در اقتصاد و شرایط اقتصادی، نوسانات آن نیز تبعات خاص خود را داراست، اصولاً، با به هم خوردن ثبات نرخ واقعی ارز و نوسانات مکرر و نااطمینانی مستمر در مقدار واقعی نرخ ارز، روند سرمایه‌گذاری غیرمنطقی شده و تخصیص بهینه‌ی منابع امکان‌پذیر نخواهد بود. در این پژوهش با استفاده از اطلاعات سالیانه ۱۳۸۸-۱۳۴۰، اثرات نوسانات نرخ ارز بر تراز تجاری بخش کشاورزی و نیز بر عرضه‌ی صادرات سیب (به عنوان یک محصول صادراتی عمده بخش کشاورزی) و بر تقاضای واردات ذرت (به عنوان یک محصول وارداتی عمده بخش کشاورزی) مورد بررسی قرار می‌گیرد. بررسی روابط میان متغیرهای هر الگو، با استفاده از تحلیل هم‌انباشتگی و تصحیح خطای برداری (VECM) صورت گرفته است. همچنین الگوی واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو تعمیم یافته (GARCH) نیز جهت مدل‌سازی نوسانات نرخ ارز استفاده شده است. پس از محاسبه نوسانات نرخ ارز، رابطه تراز تجاری بخش کشاورزی، معادله عرضه صادرات سیب و تقاضای واردات ذرت مورد برآزش قرار گرفتند. طبق رابطه برآورد شده برای عرضه صادرات سیب، نتایج حاکی از این امر است که نوسانات نرخ ارز تاثیر منفی و معنی‌دار بر عرضه صادرات سیب دارد. در رابطه تقاضای واردات ذرت نیز نوسانات نرخ ارز با ضریبی برابر ۸.۵۶ تاثیر منفی و معنی‌دار بر این رابطه داشته است لذا می‌توان گفت که افزایش نااطمینانی نرخ ارز باعث کاهش عرضه صادرات سیب و تقاضای واردات ذرت می‌گردد. با استناد به نتایج بدست آمده از رابطه تعادلی بلندمدت مربوط به تراز تجاری کل بخش، می‌توان گفت که ضریب مربوط به متغیر نرخ ارز معنی‌دار بوده و با افزایش یک



درصدی نرخ ارز، تراز تجاری به اندازه ۲/۴۲٪ افزایش می‌یابد. به عبارتی با تضعیف پول ملی، تراز تجاری بخش کشاورزی بهبود می‌یابد. همچنین در مورد تاثیر نوسانات نرخ ارز بر تراز تجاری، نتایج بدین صورت است که بی‌ثباتی نرخ ارز به طور منفی و با ضریبی برابر ۳/۸۸- بر تراز تجاری بخش کشاورزی اثرگذار است. ضریب برآورد شده برای متغیر نرخ ارز در تابع عرضه صادرات سیب، مثبت و معنی‌دار بوده و برابر ۲/۵ می‌باشد به عبارتی می‌توان گفت که افزایش یک درصدی نرخ ارز واقعی، موجب افزایش ۲/۵ درصدی عرضه صادرات سیب خواهد شد. در مورد تاثیر نرخ ارز بر تقاضای واردات ذرت نیز نتایج حاکی از این است که با افزایش یک درصدی نرخ ارز واقعی، واردات ذرت به مقدار ۱/۶۸ درصد کاهش می‌یابد.

**واژگان کلیدی:** نوسانات نرخ ارز، نرخ ارز، تجارت خارجی، صادرات، واردات، تراز تجاری، بخش

کشاورزی.

## فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱	فصل اول: کلیات تحقیق.....
۲	مقدمه.....
۴	۱) بیان مساله.....
۶	۲) اهمیت موضوع.....
۹	۳) اهداف تحقیق.....
۹	۴) سوالات تحقیق.....
۹	۵) فرضیات تحقیق.....
۹	۶) روش شناسی تحقیق.....
۱۱	فصل دوم: بررسی ادبیات تحقیق و مروری بر مطالعات انجام شده.....
۱۲	مقدمه.....
۱۲	۱-۲) مبانی نظری.....
۱۳	۲-۱-۱) پدیده منحنی جی.....
۱۵	۲-۱-۲) مارشال لرنر.....
۱۸	۲-۲) تاثیر نوسانات نرخ ارز بر صادرات و واردات.....
۲۲	۲-۲-۱) تحلیل نموداری تاثیر نرخ ارز بر صادرات و واردات بخش کشاورزی.....
۲۴	۲-۲-۳) عوامل موثر بر عرضه صادرات.....
۲۵	۲-۲-۴) عوامل موثر بر تقاضای واردات.....
۲۷	۲-۲-۵) ادبیات موضوع.....
۲۷	۲-۵-۱) مطالعات انجام شده در داخل کشور.....
۳۲	۲-۵-۲) مطالعات انجام شده در خارج از کشور.....
۴۲	فصل سوم: روش شناسی تحقیق.....
۴۳	مقدمه.....
۴۳	۱-۳) مدل سازی نوسانات نرخ ارز.....
۴۵	۳-۱-۱) مدل های HCRA و CRAGH.....
۴۶	۳-۱-۱-۳) مدل ARCH.....
۴۷	۳-۱-۱-۳) مدل CRAGH.....
۴۹	۳-۲) آزمون ایستایی متغیرها.....
۵۲	۳-۳) مفهوم هم انباشتگی.....
۵۶	۳-۴) آزمون های هم انباشتگی.....
۵۷	۳-۴-۱) آزمون انگل - گرنجر.....

۵۸	.....(۳-۴-۲)آزمون دوربین- واتسن رگرسیون هم‌انباشته کننده
۵۸	.....(۳-۵) هم‌انباشتگی و مدل تصحیح خطا
۵۹	.....(۳-۵-۱) روش انگل- گرنجر
۶۲	.....(۳-۵-۲) روش جوهانسن
۶۲	.....(۳-۵-۲-۱) الگوی خودتوضیح برداری و روش جوهانسن
۶۳	.....(۳-۵-۲-۲) تعیین تعداد بردار همگرایی و روش RAV
۶۷	..... فصل چهارم: برآورد مدل و تفسیر نتایج
۶۸	..... مقدمه
۶۸	.....(۴-۱) محاسبه نوسانات نرخ ارز
۷۰	.....(۴-۲) تابع عرضه صادرات سیب
۷۶	.....(۴-۳) تابع تقاضای واردات ذرت
۷۹	.....(۴-۴) رابطه تراز تجاری بخش کشاورزی
۸۵	..... فصل پنجم: نتیجه‌گیری و پیشنهادات
۸۶	.....(۵-۱) نتیجه‌گیری
۸۷	.....(۵-۲) سایر نتایج
۸۷	.....(۵-۳) پیشنهادات
۸۹	..... منابع و ماخذ

## فهرست جداول

صفحه	عنوان
۶۹	جدول ۴-۱) نتایج آزمون HCRA-ML
(۱)	جدول ۴-۲) نتایج آزمون جارگ- برا و ARCH-LM جهت بررسی تصریح مدل (۱)
۷۰	ARCH
۷۰	جدول ۴-۳) برآورد مدل ARCH(1) برای نرخ ارز
۷۱	جدول ۴-۴) نتایج آزمون مانایی فیلدیس- پرون در سطح متغیرها برای تابع صادرات سیب
	جدول ۴-۵) نتایج آزمون مانایی فیلدیس- پرون در سطح متغیرها برای تابع صادرات سیب
۷۲	از یک مرتبه تفاضل گیری
	جدول ۴-۶) نتایج آزمون اثر (Trace) جهت تعیین تعداد بردار همگرایی میان متغیرهای تابع
۷۳	عرضه صادرات سیب
	جدول ۴-۷) نتایج آزمون حداکثر مقدار ویژه جهت تعیین تعداد بردار همگرایی میان متغیرهای
۷۴	تابع عرضه صادرات سیب

جدول ۴-۸) برآورد بردار هم جمعی نرمال شده نسبت به متغیر وابسته ( عرضه صادرات سیب).....	۷۵
جدول ۴-۹) نتایج آزمون حداکثر مقدار ویژه جهت تعیین تعداد بردار همگرایی میان متغیرهای تابع تقاضای واردات ذرت.....	۷۷
جدول ۴-۱۰) نتایج آزمون اثر ( $\lambda_{trace}$ ) جهت تعیین تعداد بردار همگرایی میان متغیرهای تابع تقاضای واردات ذرت.....	۷۸
جدول ۴-۱۱) برآورد بردار هم جمعی نرمال شده نسبت به متغیر وابسته ( تقاضای واردات ذرت).....	۷۸
جدول ۴-۱۲) نتایج آزمون مانایی فیلیپس - پرون در سطح متغیرها برای تراز تجاری بخش کشاورزی.....	۸۰
جدول ۴-۱۳) نتایج آزمون مانایی فیلیپس - پرون در سطح متغیرها برای تر از تجاری پس از یک مرتبه تفاضل گیری.....	۸۱
جدول ۴-۱۴) نتایج آزمون اثر ( $\lambda_{trace}$ ) جهت تعیین تعداد بردار همگرایی میان متغیرهای تراز تجاری بخش کشاورزی.....	۸۱
جدول ۴-۱۵) نتایج آزمون حداکثر مقدار ویژه ( $\lambda_{max}$ ) جهت تعیین تعداد بردار همگرایی میان متغیرهای تراز تجاری بخش کشاورزی.....	۸۲
جدول ۴-۱۶) برآورد بردار هم جمعی نرمال شده نسبت به متغیر تراز تجاری.....	۸۲

### فهرست نمودارها

عنوان	صفحه
نمودار ۲-۱) آثار تقویت ریال ایران به عنوان یک کشور واردکننده بر تجارت.....	۲۲
نمودار ۲-۲) آثار کاهش ارزش بر تجارت زمانی که ایران یک کشور صادرکننده است.....	۲۳

# **فصل اول:**

## **کلیات تحقیق**

## مقدمه

در تاریخ اندیشه‌های اقتصادی بحث اثربخشی و اهمیت تجارت خارجی برای رسیدن به رشد اقتصادی و همچنین برای دسترسی به رقابت سالم اقتصادی از دوران مרקانتلیسم ها و سوداگران اقتصادی آغاز می‌گردد. در واقع تجارت خارجی را می‌توان به عنوان یکی از محرک‌های مهم رشد اقتصادی به حساب آورد. از سوی دیگر پدیده جهانی شدن اقتصاد و از بین رفتن مرزهای تجاری کشورها، به شدت در حال شکل‌گیری است و در آینده‌ای نه چندان دور، کشورها به سختی قادر خواهند بود که خود را از این جرقن کنار کشیده و تنها در حاشیه نظاره گر تحولات تجاری بین کشورها باشند. از اینرو می‌توان گفت که تجارت نقش مهمی در اقتصاد کشورها دارد. اغلب کشورها برای افزایش رشد اقتصادی به دنبال توسعه‌ی تجارت با سایر کشورها و تولید کالا بر اساس مزیت نسبی هستند. لذا انتظار می‌رود ایران نیز به نحوی خود را با تحولات تجارت در دنیا همگام نموده و برای رقابت و ورود به صحنه تجارت بین‌المللی آماده شود. در نتیجه لازم است تا هر چه سریع تر امکانات بالقوه در بخش های مختلف تولیدی کشور به ویژه بخش کشاورزی، مورد ارزیابی قرار گیرد و با دیدی شفاف نسبت به توسعه تجارت در خصوص کالاهای مختلف اقدام شود. صادرات محصولات کشاورزی نقش عمده‌ای در صادرات غیرنفتی داشته و صادرات این بخش نسبت به بخش های دیگر از ثبات بیشتری برخوردار است. بخش قابل توجهی از موفقیت کشورهای چینی، مالزی، سنگاپور، چین و کره جنوبی را می‌توان به توسعه صادرات آنها در دو دهه گذشته نسبت داد. لذا توجه به تجارت بخش کشاورزی و شناخت عوامل موثر بر آن، می‌تواند جهت دستیابی به اهداف اقتصادی موثر واقع شود.

مهم‌ترین عوامل تاثیر گذار بر تجارت هر کشور و هر بخش اقتصادی، بر اساس آنچه در تئوری‌های اقتصادی مطرح شده است، عبارتند از نرخ ارز، قیمت های نسبی، درآمد ملی و درآمد جهانی. لذا شناخت این متغیرها و نحوه‌ی اثرگذاری آنها، برای افزایش صادرات و واردات، که دو رکن اصلی تجارت هستند، به یک سطح مطلوب و نیز دانستن سرعت واکنش صادرات و واردات نسبت به

هر گونه تغییر در هر یک از این متغیرها، حائز اهمیت است. در مطالعه حاضر، علاوه بر اینکه نحوه اثرگذاری هر یک از متغیرهای فوق‌الذکر، بر توابع صادرات و واردات مورد بررسی واقع شده، تاثیر نوسانات نرخ ارز، که یکی از مباحث بحث برانگیز در زمینه تجارت می‌باشد، نیز مورد تحلیل و بررسی قرار گرفته است. چرا که نوسان نرخ ارز به عنوان منبع ریسک ناشی از نرخ ارز شناخته می‌شود که بر روی حجم تجارت و تراز پرداخت‌ها تاثیر گذار است. بر اساس مبانی نظری نوسانات بالای نرخ ارز منجر به افزایش هزینه بنگاه‌های ریسک‌گریز و همچنین کاهش تجارت خارجی خواهد شد (Hooper and Kohelhangeb, ۱۹۷۸).

امروزه در اکثر کشورهای جهان نظام شناور ارز حاکم و جاری است و در این نظام ارزی برابری ارزها یا نرخ تبدیل آن‌ها نه تنها روزانه بلکه در طول یک روز با نوساناتی همراه می‌باشند. آنچه در مبحث ارز به ویژه برای اقتصاددانان و سیاست‌گذاران از درجه اهمیت بسیار بالایی برخوردار است، این مهم است که با تغییر نرخ ارز، شاخص‌های عمده اقتصادی یعنی تولید ناخالص ملی، اشتغال، سطح عمومی قیمت‌ها و تراز پرداخت‌های ارزی چه عکس‌العملی نشان می‌دهند. لذا بررسی آثار این تغییرات بر متغیرهای اقتصادی امری مهم و ضروری می‌باشد. در این تحقیق سعی شده است که اثرات نوسانات نرخ ارز بر تراز تجاری بخش کشاورزی و نیز بر عرضه‌ی صادرات یک محصول صادراتی عمده و بر تقاضای واردات یک محصول وارداتی عمده مورد بررسی قرار گیرد. تحقیق حاضر در پنج بخش تنظیم شده است:

فصل اول شامل کلیات تحقیق می‌باشد و در فصل دوم به ادبیات موضوع پرداخته شده و در ادامه نیز مطالعات داخلی و خارجی صورت گرفته در این زمینه ارائه شده است. در فصل سوم، به توضیح مواد و روش‌های انجام تحقیق پرداخته شده و در فصل چهارم، نتایج حاصل از برآورد مدل‌های مورد مطالعه ارائه شده است. در نهایت فصل پنجم که شامل نتیجه‌گیری از تحقیق و پیشنهادات ارائه شده می‌باشد، ذکر شده است.

## ۱-۱) بیان مسأله

نوسانات نرخ واقعی ارز ناشی از شوک‌های مختلف اقتصادی (از جمله سیاست‌های داخلی) می‌باشد که بر نرخ اسمی ارز و سطح قیمت‌های داخلی اثر می‌گذارد و به این ترتیب نرخ واقعی ارز را دچار بی‌ثباتی می‌کند. این نوسانات نشان‌دهنده‌ی بی‌ثباتی و عدم قطعیت در روند قیمت‌های نسبی بین کشورهاست. نوسانات نرخ ارز به صورت مستقیم باعث ایجاد نااطمینانی و افزایش هزینه‌ها خواهد شد و به صورت غیر مستقیم بر روی تخصیص منابع و سیاست‌های دولت تاثیرگذار است (Cote, ۱۹۹۴). چرا که با به هم خوردن ثبات نرخ واقعی ارز، روند سرمایه‌گذاری، غیرمنطقی شده، تخصیص بهینه‌ی منابع امکان‌پذیر نخواهد بود.

در یک نظام بین‌المللی، ارزش پول ملی نقش اساسی در تعیین هزینه‌های اقتصادی مربوط به سرمایه‌گذاری، صادرات و واردات و تأثیر آن بر رشد اقتصادی را بازی می‌کند. ادیر<sup>۱</sup> (۱۹۷۳) بیان می‌کند که نوسانات نرخ ارز اثر منفی بر تجارت بین‌المللی خواهد گذاشت. نوسانات مکرر و نااطمینانی مستمر در نرخ‌های واقعی ارز، می‌تواند با ایجاد یک شرایط نااطمینان و متزلزل در زمینه‌ی سود ناشی از مبادلات بین‌المللی، سبب کاهش تجارت و همچنین کم‌تحرکی جریان سرمایه از طریق کاهش سرمایه‌گذاری در فعالیت‌های خارجی و به هم خوردن سبد دارایی‌های مالی شود. اضافه بر این، افزایش و تعدد نوسانات نرخ واقعی ارز سبب بالا رفتن قیمت کالاها ی قابل مبادله و افزایش خطر پوشش تغییرات پیش‌بینی نشده‌ی نرخ واقعی ارز می‌شود. در چند دهه گذشته، اقتصاددانان و سیاست‌گذاران غالباً درباره عملکرد نرخ‌های واقعی ارز در کشورهای جهان سوم مطالعات زیادی داشته‌اند و اغلب اعتقاد بر این دارند که اعمال سیاست‌های نامناسب نرخ ارز توسط برخی از کشورها، موجب تشدید بحران بدهکاری‌های بین‌المللی، وخامت وضعیت بخش کشاورزی، عدم تعادل تراز تجاری، عدم موفقیت سیاست‌های اصلاحی و تعدیلی در رفع مشکلات اقتصاد شده است.

با توجه به مطالب فوق، می‌توان گفت که یکی از مهم‌ترین بحث‌ها و چالش‌های مطرح در

---

<sup>۱</sup> Ethier



اقتصاد کلان، اثرات نوسانات نرخ ارز بر متغیرهای کلان اقتصادی است. به دلیل این که نوسانات نرخ ارز هم بخش تقاضای کل اقتصاد را از مجرای خالص صادرات و تأثیرگذاری ذخایر ارزی بانک مرکزی و نیز بخش عرضه اقتصاد را از مجرای کالاهای واسطه‌ای وارداتی، تحت تأثیر قرار می‌دهد. به‌طور کلی، در بازار کالاها شوک‌های مثبت نرخ ارز، سبب گران شدن کالاهای وارداتی و ارزان تر شدن کالاهای صادراتی خواهد شد و در نتیجه، افزایش تقاضا برای کالاهای داخلی را دربر خواهد داشت. از سوی دیگر، با کاهش ارزش پول ملی، تقاضای نقدینگی بنگاه‌های اقتصادی افزایش یافته و این امر موجب افزایش تقاضای پول نیز می‌شود. در طرف عرضه می‌توان استدلال کرد که در کشورهای در حال توسعه شوک‌های مثبت نرخ ارز (کاهش ارزش پول ملی)، سبب افزایش هزینه وارداتی کالاهای واسطه‌ای و در نتیجه، گران تر شدن واردات کالاهای واسطه‌ای (نهاده تولید) می‌شود و بدین ترتیب موجبات افزایش هزینه‌های تولید را نیز فراهم می‌آورد، که اصطلاحاً تورم وارداتی نامیده می‌شود (کازرونی، رستمی، ۱۳۸۸).

نحوه اثرگذاری هر یک از متغیرهای مؤثر بر صادرات و واردات بر اساس نظریات اقتصادی و مطالعات صورت گرفته، به استثناء تغییرات نرخ ارز، امری مشخص می‌باشد به طوری که در مورد تابع واردات قیمت‌های نسبی و نرخ ارز، تأثیر منفی و درآمد داخلی تأثیر مثبت بر واردات داشته است و در مورد صادرات هم متغیر درآمد جهانی و قیمت‌های نسبی و نرخ ارز تأثیر مثبت داشته‌اند (رحمانی، ۱۳۸۰). اما در مورد اثرات تغییرپذیری نرخ ارز بر حجم تجارت، نتایج مشخص و یکسانی حاصل نشده است. زیرا در مطالعات انجام شده، نوسانات نرخ ارز اثرات متفاوتی بر حجم تجارت داشته است. به عنوان مثال (Peree and Akhtar and Hilton(1984), Cushman(1983, 1986, 1988) و (Stinherr(1989), Brada and Mendez(1988), Ethier(1973) از جمله مطالعاتی هستند که تأثیر منفی نوسانات نرخ ارز بر تجارت را نتیجه گرفته‌اند و در مقابل مطالعاتی همچون Hooper and Kohlhausen(1978), Bailey et al(1986, 1987), Makin(1976), Gotur(1985) نمونه‌هایی هستند که نتایج مطالعه‌شان حاکی از این امر است که جریان‌ات تجاری نسبت به نوسانات نرخ ارز حساسیت

معنی داری ندارند. لازم به ذکر است که اکثر مطالعات انجام شده در زمینه ارتباط نوسانات نرخ ارز و تجارت، در مورد کشورهای صنعتی به پژوهش پرداخته‌اند و اغلب تجارت بخش صنعت را مورد بررسی قرار داده‌اند و تعداد اندکی از مطالعات، به بررسی تجارت بخش کشاورزی پرداخته‌اند. لذا با توجه به مطالب عنوان شده بررسی چگونگی تأثیرپذیری تجارت بخش کشاورزی ایران از تغییرات نرخ ارز، که از اهداف اصلی این پژوهش می‌باشد، امری مهم و قابل توجه است.

## ۱-۲) اهمیت موضوع

جهش صادرات غیرنفتی در برنامه‌های پنج ساله‌ی توسعه‌ی 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. بخش کشاورزی منبع اصلی تامین‌کننده نیازهای اساسی جوامع در حال توسعه است و لذا بیشترین اهمیت را در برنامه‌های توسعه‌ی این کشورها دارا می‌باشد. در ایران نیز، کشاورزی یکی از بخش‌های اصلی اقتصاد است که به سبب سهم آن در تولید ناخالص ملی، اشتغال، بخش خارجی و تامین امنیت غذایی در حیطه سیاست تجاری باید مورد توجه خاصی قرار بگیرد. بعلاوه، این بخش اهمیت زیادی در استقلال اقتصادی و خودکفایی اقتصاد کشور دارد و استقلال اقتصادی به نوبه خود یکی از اصول مهم قانون اساسی کشور می‌باشد. بخش کشاورزی بستر فعالیت اقتصادی نزدیک به نیمی از جمعیت کشور است و وابستگی کمتر به تکنولوژی پیچیده و همچنین امکانات گسترش تولید از جمله مشخصه‌های این بخش محسوب می‌گردد (فرهادی، ۱۳۸۰). از آنجائی که، یکی از بخش‌های مهم در صادرات غیرنفتی، صادرات بخش کشاورزی می‌باشد، اشاره به وضعیت صادرات و واردات این بخش حائز اهمیت است. بر اساس گزارشات آمار بازرگانی خارجی گمرک جمهوری اسلامی ایران، در سال ۱۳۸۶ ارزش صادرات کشاورزی برابر ۳۶۶۰/۹ هزار دلار بوده که برابر سهم ۲۳/۹ درصدی از ارزش کل صادرات غیرنفتی می‌باشد. طی سال‌های ۱۳۸۵ و ۱۳۸۴ نیز سهم بخش کشاورزی از کل

صادرات غیرنفتی به ترتیب برابر ۲۳/۷ و ۲۲/۸ درصد می‌باشد. طی همین سال‌ها سهم واردات بخش کشاورزی از کل واردات کشور برای سال ۱۳۸۶ برابر ۱۱/۲، سال ۱۳۸۵ برابر ۱۱/۸ و در سال ۱۳۸۴ به میزان ۸/۳ درصد بوده است. بر اساس آمار فوق و توجه به اینکه ایران کشور ری با پتانسیل‌های فراوان در بخش کشاورزی (به ویژه در زمینه‌ی پسته، خرما، زعفران، کشمش، انگور و سیب درختی و ...) می‌باشد، در این پژوهش تلاش بر این است که با شناسایی عوامل مؤثر بر تجارت بخش کشاورزی، گامی در جهت ارتقاء تجارت این بخش و جایگاه جهانی آن، برداشته شود.

با بررسی وضعیت محصولات کشاورزی در رده‌های جهانی نتایج بدست آمده نشانگر این است ایران در بخشی از محصولات مقام‌های اول تا هفتم را دارد، به عنوان مثال در تولید پسته مقام اول، خرما مقام دوم، انار رتبه اول و در تولید گیلاس، انگور، سیب، بادام، مرکبات و انجیر رتبه‌های اول تا هفتم دنیا را به خود اختصاص داده است. پس می‌توان اظهار کرد که ایران به عنوان یکی از کشورهای عمده تولیدکننده میوه جهان می‌باشد و از نظر تنوع از حدود ۱۰۰ نوع محصول باغی دنیا ۵۰ محصول در ایران تولید می‌شود و از نظر تنوع تولید در دنیا رتبه بسیار قابل توجهی دارد (خبرنامه اتحادیه تولیدکنندگان، صادرکنندگان و واردکنندگان میوه و تره‌بار، سبزی و صیفی، گل و نهال ایران، ۱۳۸۸).

در مطالعه حاضر، جهت بررسی چگونگی تاثیرپذیری عرضه صادرات محصولات کشاورزی از نوسانات نرخ ارز، از میان محصولات مختلف کشاورزی، محصول باغی سیب به عنوان یکی از مهمترین محصولات صادراتی بخش کشاورزی انتخاب شده است. علت انتخاب این محصول این امر است که ایران به دلیل داشتن شرایط آب و هوایی مناسب برای کشت سیب به عنوان یکی از محصولات سردسیری، جایگاه ممتازی در دنیا دارد. همچنین سیب درختی از جمله محصولات صادراتی ایران است که در سال‌های اخیر سهم قابل توجهی از بازارهای کشورهای همسایه را به خود اختصاص داده که می‌توان از طریق گسترش و ترویج کشت این محصول و فراورده هایش به صورت اقلام مهم صادراتی علاوه بر ایجاد اشتغال و درآمدزایی، به عنوان یک منبع تا مین ارز نیز از آن بهره برد .

همچنین طبق گزارش گمرک در سال ۱۳۸۸، ایران ۴ درصد تولید جهانی و ۱/۵ درصد صادرات جهانی سیب را در اختیار دارد و با توجه به تخصیص مشوق‌های گوناگون در سال‌های اخیر به صادرکنندگان محصولات فسادپذیر، در مجموع صادرات سیب درختی به غیر از سال ۱۳۸۳ که تحت تاثیر کمبود تولید، روند نزولی داشته در مابقی سال‌ها از افزایش و رشد مناسبی برخوردار بوده است. در سال ۱۳۸۷ به علت خشکسالی و سرمازدگی میزان صادرات کشور کاهش را نشان می‌دهد.

از میان محصولات وارداتی بخش کشاورزی، محصول ذرت جهت بررسی رابطه میان نوسانات نرخ ارز و تقاضای واردات محصولات کشاورزی، مورد گزینش قرار گرفت در مورد این محصول می‌توان گفت که با توجه به موارد استعمال گوناگون این گیاه و افزایش روزافزون تقاضا، دولت به ناچار سالانه مقدار چشمگیری ذرت را از بازار جهانی خریداری می‌کند. البته در چند سال اخیر تولید این محصول در کل استان‌های کشور نیز به مراتب افزایش داشته است و این خود می‌تواند تا حدی پاسخگوی نیازهای بشر باشد. دولت نیز با توجه به اهمیت این محصول در ایران و سیاست خودکفایی، در جهت حمایت از تولید داخلی و کاهش واردات این محصول در سال‌های اخیر محدودیت‌هایی را در برابر واردات این محصول اعمال کرده است. لازم به ذکر است که در سال ۲۰۱۰ مقدار مصرف ذرت ایران ۵.۶۵ میلیون تن بود که برای جبران کمبود آن ۳/۲ میلیون تن واردات داشته‌ایم و این باعث شد به عنوان هشتمین کشور واردکننده ذرت در جهان شناخته شویم. (گزارش انجمن صنفی تولیدکنندگان جوجه یک روزه، ۱۳۸۹). در نتیجه بررسی عوامل تأثیرگذار بر واردات این محصول نیز دارای اهمیت فراوان است. با توجه به مطالب ذکر شده و اهمیت بخش کشاورزی و توجه به نقشی که می‌تواند در بهبود وضعیت تجاری کشور ایفا کند و همچنین توجه به نقشی که نوسانات نرخ ارز می‌تواند در زمینه تجارت بخش‌های مختلف اقتصادی داشته باشد، ضرورت انجام مطالعه حاضر مشخص می‌شود.