

بِسْمِ اللّٰهِ الرَّحْمٰنِ الرَّحِیْمِ



دانشکده کشاورزی

گروه اقتصاد کشاورزی

پایان نامه تحصیلی برای دریافت درجه کارشناسی ارشد رشته اقتصاد کشاورزی

تأثیر نااطمینانی نرخ ارز بر رشد و تجارت خارجی کشاورزی در ایران

استاد راهنما:

دکتر حسین مهرابی بشرآبادی

استادان مشاور:

دکتر محمدرضا زارع مهرجردی

دکتر سیدعبدالمجید جلائی اسفندآبادی

مؤلف:

ابراهیم جاودان

بهمن ماه ۱۳۸۹

تقدیم به

پدر بزرگوارم،

بهترین استادم که از او بسیار آموختم و همواره خود را تشنه معلومات و مدیون زحمات او می دانم.

مادر عزیزم،

که اسوه ایثار است و آینه مهر، چشمان پر امید و دستان مهربانش را هرگز همتایی نیافتم.

برادران و خواهران ارجمندم،

که یکایک مشوق، راهنما و یآوری امین در طول دوران تحصیلم بوده اند.

تشکر و قدردانی

الهی تو را به وسعت بیکران عظمت سپاس می‌گویم که توانم دادی تا برگ دیگری از دفتر زندگیم را با موفقیت ورق بزنم. بدون تردید اتمام این رساله پس از توفیق الهی مدیون راهنمایی‌های صمیمانه اساتید بزرگواری است که جا دارد بر حسب وظیفه تشکر و قدردانی خود را ابراز نمایم.

مراتب سپاس و قدردانی خود را تقدیم استاد راهنمای ارجمندم، جناب آقای دکتر حسین مهرابی می‌نمایم که در این دوره از تحصیل مرا از دانش بی‌مثالشان بهره‌مند ساختند و شاگردی ایشان برایم افتخاری بس بزرگ است. رهنمودها و دقت نظر ایشان از مراحل اولیه انتخاب موضوع تا نگارش پایانی، بی‌نظیر و ستودنی بود.

باید تقدیر و تشکر بکنم از استاد مشاور گرامیم جناب آقای دکتر محمدرضا زارع که از مشاوره‌ها و حمایت‌های ایشان در این مقطع تحصیلی برخوردار بوده‌ام.

تقدیر و تشکر می‌نمایم از استاد مشاور بزرگواریم جناب آقای دکتر سیدعبدالمجید جلائی که با اشرافی عالمانه همیشه پاسخگوی سوال‌های من بوده‌اند و نظرات تخصصی و ارزشمند ایشان در مراحل مختلف پایان‌نامه برایم راهگشا و کارساز بودند.

از استاد عزیزم جناب آقای دکتر حمیدرضا میرزایی تشکر می‌کنم که علی‌رغم مشغله کاری، زحمت داوری پایان‌نامه را عهده‌دار شدند.

از جناب آقای دکتر پورسیدی، معاونت محترم پژوهشی و تحصیلات تکمیلی دانشکده به واسطه حمایت تمام ایشان در انجام امور پایان‌نامه تشکر می‌نمایم.

همچنین تشکر و امتنان قلبی خود را خدمت خانواده بسیار عزیزم تقدیم می‌نمایم که همیشه و در تمامی مراحل تحصیل مشوق و پشتیبانم بوده‌اند. امید که فرصت اندک جبرانی فراهم گردد.

در نهایت باید تشکر داشته باشم از جناب آقای مهندس قدیمی و جناب آقای کوهپایه‌زاده که در این مقطع تحصیلی از حمایتشان در امور اداری بخش اقتصاد کشاورزی برخوردار بوده‌ام. علاوه بر این سپاس خودم را تقدیم دوستان عزیز همکلاسی، هم رشته‌ای و دیگر دوستان بزرگواریم می‌نمایم که در انجام پایان‌نامه از دانش و تجربه‌شان بهره بردم که در این مجال اندک ذکر اسامی همه آنان مقدور نیست.

چکیده

بسیاری از تحلیل‌گران اقتصاد بین‌الملل اتفاق نظر دارند که فراگیر شدن نظام ارزی شناور بعد از نظام برتون وودز، نااطمینانی قابل توجهی را در اقتصاد کشورهای در حال توسعه و توسعه یافته ایجاد کرده است. این مطالعه اثر نااطمینانی نرخ ارز واقعی را بر رشد بخش کشاورزی ایران در دوره ۱۳۸۶-۱۳۴۸، صادرات محصولات کشاورزی ایران در دوره ۲۰۰۷-۱۹۹۸ و واردات محصولات کشاورزی ایران در دوره ۲۰۰۸-۱۹۹۸ مورد بررسی قرار داده است. به این منظور، الگوی واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو تعمیم یافته (GARCH) برای شاخص‌سازی نااطمینانی نرخ ارز واقعی استفاده شد. برای برآورد الگوی رشد، رهیافت همجمعی خودتوضیح با وقفه‌های گسترده (ARDL) به کار گرفته شد. الگوی صادرات و واردات محصولات کشاورزی نیز با استفاده از داده‌های پانل در قالب مدل جاذبه مورد برآورد قرار گرفت. بر اساس یافته‌های این پژوهش، روابط کوتاه‌مدت و بلندمدت قوی و معنی‌داری بین متغیرها در مدل رشد بخش کشاورزی ایران وجود دارد و نااطمینانی نرخ ارز واقعی اثر منفی و معنی‌داری بر رشد بخش کشاورزی در کوتاه‌مدت و بلندمدت داشته است. ضریب تصحیح خطا (۰/۷۱-) نیز با علامت منفی و معنی‌دار گویای سرعت بالای فرایند تعدیل است. برآورد مدل جاذبه برای صادرات و واردات محصولات کشاورزی نیز حاکی از آن است که نااطمینانی نرخ ارز واقعی اثر منفی و معنی‌داری بر این دو متغیر در دوره مورد مطالعه داشته است. با توجه به نتایج پژوهش، سیاست‌های اقتصادی در کشور باید به صورت هماهنگ و در راستای کاهش نااطمینانی نرخ ارز واقعی طراحی و اجرا شوند. علاوه بر این پیشنهاد می‌شود برای جبران ضرر وارده به صادرکنندگان و واردکنندگان در اثر نااطمینانی نرخ ارز واقعی، استفاده از سیاست‌های حمایتی و الگوهای بیمه‌ای در دستور کار سیاست‌گذاران قرار گیرد.

واژه‌های کلیدی: بخش کشاورزی، رشد، صادرات، واردات، نااطمینانی، نرخ ارز واقعی، ایران

فهرست مطالب

عنوان	صفحه
فصل اول (کلیات و مفاهیم)	
۱-۱- مقدمه	۲
۲-۱- ضرورت انجام تحقیق	۳
۳-۱- فرضیه‌های تحقیق	۴
۴-۱- اهداف تحقیق	۴
۵-۱- نقش بخش کشاورزی در اقتصاد ایران	۴
۶-۱- نقش بخش کشاورزی در تجارت خارجی ایران	۵
۷-۱- ساختار پایان‌نامه	۶
فصل دوم (مروری بر منابع)	
۱-۲- مقدمه	۸
۲-۲- مطالعات مربوط به رشد اقتصادی	۹
۲-۲-۱- مطالعات داخلی	۹
۲-۲-۲- مطالعات خارجی	۱۴
۳-۲- مطالعات مربوط به تجارت خارجی	۱۹
۳-۲-۱- مطالعات داخلی	۱۹
۳-۲-۲- مطالعات خارجی	۲۳
۴-۲- مطالعات مربوط به مدل جاذبه	۲۸
۴-۲-۱- مطالعات داخلی	۲۸
۴-۲-۲- مطالعات خارجی	۳۲
۵-۲- جمع‌بندی	۳۶
فصل سوم (مبانی نظری و روش‌شناسی تحقیق)	
۱-۳- مقدمه	۳۸
۲-۳- نرخ ارز	۳۹
۳-۳- نرخ ارز واقعی	۳۹
۴-۳- بازار ارز خارجی	۴۰
۵-۳- نظام ارزی یا رژیم نرخ ارز	۴۰

- ۳-۶- برخی اصطلاحات مربوط به نظام‌های ارزی ۴۱
- ۳-۷- پیشینه تاریخی نظام‌های ارزی ۴۱
- ۳-۸- ترتیبات کنونی نرخ ارز ۴۲
- ۳-۹- نااطمینانی نرخ ارز ۴۳
- ۳-۱۰- نظریه برابری قدرت خرید ۴۴
- ۳-۱۰-۱- نظریه برابری قدرت خرید مطلق ۴۵
- ۳-۱۰-۲- نظریه برابری قدرت خرید نسبی ۴۵
- ۳-۱۱- الگوی واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو تعمیم یافته ۴۶
- ۳-۱۲- مدل رشد بخش کشاورزی ۴۹
- ۳-۱۲-۱- مدل رشد سولو ۴۹
- ۳-۱۲-۲- رابطه مبادله خالص ۵۵
- ۳-۱۲-۳- شاخص ادغام تجارت بین‌الملل ۵۵
- ۳-۱۳- الگوی خودتوضیح با وقفه‌های گسترده ۵۵
- ۳-۱۴- مدل جاذبه ۵۸
- ۳-۱۵- برآورد داده‌های پانل (ترکیبی) ۶۰
- ۳-۱۵-۱- مدل اثر ثابت ۶۲
- ۳-۱۵-۲- مدل اثر تصادفی ۶۳
- ۳-۱۵-۳- آزمون‌های تشخیصی ۶۴
- ۳-۱۵-۴- شاخص تشابه ساختار اقتصادی ۶۶
- ۳-۱۶- داده‌های مورد استفاده ۶۶

فصل چهارم (نتایج و بحث)

- ۴-۱- مقدمه ۶۹
- ۴-۲- محاسبه نرخ ارز واقعی ۷۰
- ۴-۳- شاخص‌سازی نااطمینانی نرخ ارز واقعی ۷۰
- ۴-۴- برآورد الگوی رشد بخش کشاورزی ایران ۷۳
- ۴-۴-۱- برآورد الگوی پویا ۷۴
- ۴-۴-۲- برآورد الگوی بلندمدت ۷۶
- ۴-۴-۳- برآورد الگوی تصحیح خطا ۸۰
- ۴-۵- برآورد الگوی صادرات محصولات کشاورزی ۸۱
- ۴-۶- برآورد الگوی واردات محصولات کشاورزی ۸۴

فصل پنجم (جمع‌بندی و پیشنهادها)

۸۹	۱-۵- مقدمه
۹۰	۲-۵- جمع‌بندی
۹۰	۳-۵- آزمون فرضیه‌ها
۹۱	۴-۵- پیشنهادها
۹۱	۱-۴-۵- پیشنهادهای اجرایی
۹۱	۲-۴-۵- پیشنهادهای تکمیلی
۹۲	منابع

پیوست‌ها

۱۰۰	خروجی‌های نرم‌افزاری
-----	----------------------

فهرست جداول

۱۸	جدول ۱-۲. خلاصه مطالعات مربوط به نااطمینانی نرخ ارز و رشد اقتصادی
۲۷	جدول ۲-۲. خلاصه مطالعات مربوط به نااطمینانی نرخ ارز و تجارت خارجی
۳۵	جدول ۳-۲. خلاصه مطالعات مربوط به مدل جاذبه و داده‌های پانل
۴۳	جدول ۱-۳. نظام نرخ ارز مورد استفاده توسط کشورهای مختلف
۷۰	جدول ۱-۴. نرخ ارز واقعی محاسباتی (ریال)
۷۱	جدول ۲-۴. برآورد معادله رفتاری نرخ ارز واقعی
۷۱	جدول ۳-۴. آزمون واریانس ناهمسانی ARCH LM
۷۲	جدول ۴-۴. برآورد الگوی GARCH(1,1)
۷۳	جدول ۵-۴. نتایج آزمون ایستایی متغیرها
۷۴	جدول ۶-۴. برآورد الگوی پویای ARDL(1,0,0,0,0,0)
۷۵	جدول ۷-۴. آزمون‌های تشخیصی الگوی پویا
۷۶	جدول ۸-۴. برآورد الگوی بلندمدت
۸۰	جدول ۹-۴. برآورد الگوی تصحیح خطا
۸۱	جدول ۱۰-۴. نتایج آزمون‌های تشخیصی مدل صادرات
۸۲	جدول ۱۱-۴. برآورد مدل جاذبه صادرات محصولات کشاورزی
۸۴	جدول ۱۲-۴. برآورد معادله فاصله
۸۵	جدول ۱۳-۴. نتایج آزمون‌های تشخیصی مدل واردات

جدول ۴-۱۴. برآورد مدل جاذبه واردات محصولات کشاورزی..... ۸۶

جدول ۴-۱۵. برآورد معادله فاصله..... ۸۷

فهرست نمودارها

نمودار ۳-۱. تغییرات حجم سرمایه در مدل سولو..... ۵۲

نمودار ۳-۲. نرخ رشد سرمایه در مقادیر کمتر سرمایه سرانه بیشتر است..... ۵۳

نمودار ۴-۱. شاخص نااطمینانی نرخ ارز واقعی طی دوره ۸۷-۱۳۳۸..... ۷۲

فصل اول

کلیات و مفاهیم

۱-۱ مقدمه

نرخ ارز، متغیری است که بیش از سایر متغیرها با بخش خارجی اقتصاد ارتباط مستقیم و تنگاتنگ دارد. امروزه، ارزش پول کشورها نه تنها تحت تأثیر سیاست‌های اقتصادی داخل هر کشور قرار دارد، بلکه نوسانات ارزی در بازارهای جهانی نیز بر ارزش پول و به تبع آن بر تجارت خارجی آنها مؤثر می‌باشد (عسگری، ۱۳۸۷). علاوه بر این، رشد اقتصادی از جمله مهم‌ترین متغیرهای اقتصادی است که نسبت به تحولات نرخ واقعی ارز حساسیت بسیاری را نشان می‌دهد. چنانچه نرخ ارز به طور مناسب و هماهنگ با دنیای داخل و خارج اقتصاد و در یک فضای مطمئن تنظیم نشده باشد، سبب کندی رشد اقتصاد خواهد شد (حلافی، ۱۳۸۶). با توجه به نقشی که بخش کشاورزی در اقتصاد ایران ایفا می‌کند رشد این بخش از اهداف اولیه و اساسی سیاست‌گذاران به شمار می‌رود و در اقتصاد تک محصولی و مبتنی بر نفت ایران که گسترش روابط تجاری و افزایش صادرات غیرنفتی به ضرورتی اجتناب‌ناپذیر تبدیل شده است، صادرات بخش کشاورزی از میان ارقام صادرات غیرنفتی، اهمیت به سزایی داشته و توسعه آن در رأس برنامه‌های اقتصادی کشور قرار دارد. از طرف دیگر، کشور واردکننده برخی محصولات کشاورزی می‌باشد که واردات این ارقام به لحاظ نقش آفرینی در تأمین امنیت غذایی و فراهم آوردن مواد اولیه دیگر بخش‌های تولیدی اهمیت بالایی دارد. به دلیل سهم بخش کشاورزی در تولید ناخالص داخلی و تجارت خارجی غیرنفتی ایران، مطالعه عوامل تأثیرگذار بر رشد و تجارت خارجی این بخش ضروری می‌باشد که تحقیق حاضر به بررسی تأثیر نااطمینانی نرخ ارز واقعی بر رشد و تجارت خارجی کشاورزی ایران پرداخته است. در این فصل تلاش شده است ضمن تبیین ضرورت انجام تحقیق، اهداف و فرضیه‌های آن، نقش بخش کشاورزی در اقتصاد ملی نیز مورد بررسی قرار گیرد.

۲-۱ ضرورت انجام تحقیق

رشد و تجارت خارجی از طریق متغیرهای گوناگون تحت تأثیر قرار می‌گیرند که علاوه بر این، ارتباط متقابلی بین این دو فاکتور مهم در مطالعات مختلف گزارش شده است. عوامل و متغیرهای گوناگون اقتصادی بر رشد و تجارت خارجی تأثیر گذارند که نرخ ارز یک متغیر مؤثر در این زمینه است. در حوزه تجارت خارجی، نرخ ارز به عنوان پل ارتباطی و از اثرگذارترین متغیرها محسوب می‌شود. نرخ ارز از طریق تأثیر بر تجارت خارجی، رشد بخش را نیز تحت تأثیر خود قرار می‌دهد. نرخ ارز به عنوان معیار ارزش برابری پول ملی یک کشور در برابر پول کشورهای دیگر و منعکس‌کننده وضعیت اقتصادی آن کشور در مقایسه با شرایط اقتصادی سایر کشورهاست. در یک اقتصاد باز، نرخ ارز به دلیل ارتباط متقابل آن با سایر متغیرهای داخلی و خارجی، متغیری کلیدی به شمار می‌رود که سیاست‌های اقتصادی داخلی و خارجی و تحولات اقتصادی، تأثیرات بسیاری بر آن می‌گذارند. در مقابل نرخ ارز متغیری است که می‌تواند عملکرد اقتصاد و متغیرهای اقتصادی را تحت تأثیر قرار دهد (حلافی و همکاران، ۱۳۸۳). با گسترش دامنه تجارت بین‌الملل، نرخ ارز به عنوان پل ارتباطی بین اقتصادهای مختلف عمل کرده و نوسانات آن سایر متغیرهای اقتصادی کشورها را تحت تأثیر قرار می‌دهد و به دلیل وجود ارتباط ساختاری بین همه متغیرهای کلان اقتصادی، نوسانات نرخ ارز می‌تواند از طرق مختلف سطح قیمت‌ها، تولید، صادرات و واردات را متأثر سازد. لذا، یکی از دلایل اصلی طرفداران نظام ارزی ثابت، آن است که این نظام با کاهش دامنه نوسانات نرخ ارز، محیط مساعدتری را برای تولید، تجارت و سرمایه‌گذاری بین‌المللی فراهم می‌کند. اما به هر حال از اواسط دهه ۱۹۷۰، بسیاری از کشورهای در حال توسعه، نظام ارزی خود را از نظام ثابت به نظام‌هایی با درجات متفاوتی از انعطاف تغییر دادند. انتخاب نظام‌های ارزی شناور، زمینه نوسانات بیشتر نرخ ارز را فراهم می‌آورد. نوسانات وسیع نرخ ارز که از ویژگی‌های کشورهای در حال توسعه می‌باشد فضای نااطمینانی را برای تصمیم‌گیری‌های تولیدی و تجاری ایجاد می‌کند. بنابراین در مطالعات اخیر اثر نوسانات و نااطمینانی نرخ ارز از دیدگاه‌های رشد، سرمایه‌گذاری و رشد مورد بررسی قرار گرفته است. به دلیل اهمیت و سهم بخش کشاورزی در تولید ناخالص داخلی و نقش تجارت خارجی محصولات کشاورزی در اقتصاد غیرنفتی کشور و همچنین به دلیل نقش تعیین‌کننده‌ای که نرخ ارز در شکل‌گیری مناسبات تولید و تجارت خارجی دارد، آگاهی از این که نااطمینانی نرخ ارز تا چه اندازه رشد بخش کشاورزی و تجارت خارجی محصولات کشاورزی را متأثر می‌کند، مهم به نظر می‌رسد. تا آنجا که علم به این موضوعات می‌تواند گامی مؤثر در راستای سیاست‌گذاری برای ایجاد و حفظ تولید و

تجارت پایدار کشاورزی گردد. لذا مطالعه حاضر در پی آن است که عوامل مؤثر بر رشد بخش کشاورزی و تجارت خارجی محصولات کشاورزی ایران را مدل‌سازی نموده و اثر نااطمینانی نرخ ارز واقعی بر رشد و تجارت خارجی کشاورزی را مورد بررسی قرار دهد و به دنبال پاسخ به این سوال اساسی است که نااطمینانی نرخ ارز چه تأثیری بر رشد بخش کشاورزی، صادرات و واردات محصولات کشاورزی در ایران دارد.

۳-۱ فرضیه‌های تحقیق

- ۱) نااطمینانی نرخ ارز تأثیر منفی بر رشد بخش کشاورزی ایران دارد.
- ۲) نااطمینانی نرخ ارز تأثیر منفی بر صادرات محصولات کشاورزی ایران دارد.
- ۳) نااطمینانی نرخ ارز تأثیر معنی‌داری بر واردات محصولات کشاورزی ایران ندارد.

۴-۱ اهداف تحقیق

- ۱) بررسی تأثیر نااطمینانی نرخ ارز بر رشد بخش کشاورزی ایران
- ۲) بررسی تأثیر نااطمینانی نرخ ارز بر صادرات محصولات کشاورزی ایران
- ۳) بررسی تأثیر نااطمینانی نرخ ارز بر واردات محصولات کشاورزی ایران

۵-۱ نقش بخش کشاورزی در اقتصاد ایران

مهم‌ترین نقش بخش کشاورزی در اقتصاد ایران بعد از بخش خدمات اثر درآمدی و اشتغال آن است. طبق گزارش بانک جهانی، درآمدهای ارزی حاصل از منابع طبیعی در دوره رونق اقتصاد جهانی، منابع را از تولید کالاهای قابل تجارت به تولید کالاهای غیرقابل تجارت تغییر می‌دهد و منجر به بیماری هلندی می‌شود. در ایران نیز بیماری هلندی بعد از افزایش قیمت نفت در سال ۱۳۵۲ بوجود آمد و در اثر افزایش سریع درآمدهای ارزی، گرایش کشور به تجارت خارجی متمایل گردید و واردات افزایش یافت و در اثر این گرایش، قیمت مواد اولیه و دستمزدهای قابل تجارت افزایش و در نتیجه قدرت رقابت آنها کاهش یافت و اقتصاد کشور به سوی بخش‌های خدمات و ساختمان سوق پیدا کرد (عسگری، ۱۳۸۲). نگاهی به سهم اشتغال بخش کشاورزی در کشورهای در حال توسعه نشان می‌دهد در طی چهار دهه گذشته سهم اشتغال بخش کشاورزی در این کشورها به طور قابل توجهی کاهش یافته است؛ اگرچه هنوز سهم اشتغال این بخش در این دسته کشورها بسیار بیشتر از کشورهای توسعه یافته است. روند توزیع جمعیت شاغل در ایران طی سال‌های ۷۵-۱۳۳۵ گویای این است که کشور ایران نیز از همان قاعده کلی در سایر کشورها تبعیت کرده است. آمارها نشان می‌دهد که در سال ۱۳۳۵ بیش از نیمی (۵۶/۳ درصد) از کل

جمعیت شاغل در بخش کشاورزی فعالیت داشته‌اند. در طی سال‌های ۷۵-۱۳۳۵ سهم بخش کشاورزی از کل اشتغال بیش از ۶۰ درصد کاهش یافته و از ۵۶/۳ درصد در سال ۱۳۳۵ به ۲۳/۵ درصد در سال ۱۳۷۵ رسیده است و برآوردها و نمونه‌گیری‌های بعدی حاکی از آن است که در سال ۱۳۸۳ به حدود ۲۱ درصد رسیده است (فرجادی، ۱۳۸۵). سهم اشتغال این بخش با جهشی گسترده به ۲۳/۵ درصد در سال ۱۳۸۴ افزایش یافته است (خالدی و رحیم‌زاده، ۱۳۸۷). میزان ارزش افزوده بخش کشاورزی در طول سال‌های ۱۳۸۶-۱۳۷۰ به استثنای سال‌هایی که کشور دچار کمبود بارندگی بوده است (۱۳۸۰-۱۳۷۸)، از روند صعودی مناسبی برخوردار بوده، به طوری که از ۳۵۰۹۴ میلیارد ریال در سال ۱۳۷۰ به ۶۵۰۶۲ میلیارد ریال در سال ۱۳۸۶ افزایش پیدا کرده است (۱/۸۵ برابر). متوسط ارزش افزوده کشاورزی به قیمت ثابت طی دوره مزبور برابر ۵۰۲۹۵ میلیارد ریال و متوسط سهم آن در GDP علی‌رغم نوسان‌های جزئی، حدود ۱۵/۲۵ درصد بوده است. مروری بر سهم بخش کشاورزی در اشتغال و ارزش افزوده کل اقتصاد بیانگر این واقعیت است که این بخش همچنان یک بخش تأثیرگذار و مهم در اقتصاد ایران محسوب می‌شود (خالدی و رحیم‌زاده، ۱۳۸۷؛ آمارهای بانک مرکزی).

۱-۶ نقش بخش کشاورزی در تجارت خارجی ایران

موضوع تجارت بین‌الملل سابقه دیرینه داشته و یکی از بحث‌انگیزترین مسائل اقتصادی است. تا زمان مرکانتلیست‌ها اصولاً تجارت بین‌ملتها رابطه‌ای تلقی می‌شد که به سود یکی و به زیان دیگری است. برخی از اقتصاددانان، که پس از مرکانتلیست‌ها ظهور کردند، معتقدند که کشورها باید توسعه ملی خود را در متن اقتصاد جهانی و تجارت خارجی دنبال کنند. چرا که وضعیت نسبی به گونه‌ای است که تجارت خارجی می‌تواند نقش اساسی در توسعه کشورهای صادرکننده مواد اولیه داشته باشد و تجارت موتور توسعه است که برای طرفین مبادله، ایجاد مازاد می‌کند. این در حالی است که برخی از اقتصاددانان استدلال می‌کنند که منافع حاصل از تجارت، در عرصه بین‌الملل، به سود کشورهای پیشرفته تغییر جهت داده است. به گونه‌ای که تجارت خارجی مانع توسعه صنعتی ملل فقیر شده و تجارت آزاد در واقعیت، نابرابری بین‌المللی را تشدید کرده است. برای کشورهای در حال توسعه، تجارت به ویژه پس از جنگ جهانی دوم، نه تنها وسیله‌ای برای تأمین نیازها و کمبودها بوده بلکه در بعدی وسیع‌تر، راهبردی برای توسعه اقتصادی این گروه از کشورها مطرح شده است. جایگاه تجارت خارجی در مباحث توسعه در کشورهای در حال توسعه تا جایی اهمیت یافته است که اغلب از آن به عنوان موتور رشد و توسعه اقتصاد داخلی نام برده می‌شود (طیب‌زاده، ۱۳۸۷). در سال‌های ۱۳۸۶-۱۳۷۰ صادرات بخش کشاورزی

روند رو به رشدی داشته است. ارزش صادرات محصولات کشاورزی در سال‌های ۱۳۷۵-۱۳۷۲ و ۱۳۸۴-۱۳۸۰ بیش از یک میلیارد دلار گزارش شده است. خشکسالی سال‌های اخیر باعث شده است که سیاست‌های توسعه صادرات غیرنفتی به ویژه صادرات محصولات کشاورزی دچار اختلالاتی خاص گردد. متوسط ارزش صادرات محصولات کشاورزی در سال‌های ۱۳۸۴-۱۳۷۰ حدود ۱۲۰۹ میلیون دلار بوده است. سهم صادرات محصولات کشاورزی در صادرات غیرنفتی از ۲۹/۳ درصد در سال ۱۳۷۰ به ۳۰/۵ درصد در سال ۱۳۸۴ افزایش یافته است. متوسط سهم ارزش صادرات کشاورزی در صادرات غیرنفتی کشور در این دوره حدود ۲۹ درصد است. افزایش سهم صادرات محصولات کشاورزی در GDP کشور از ۰/۱ درصد در سال ۱۳۷۰ به ۱/۷ درصد در سال ۱۳۸۴ نشان می‌دهد با اتخاذ سیاست‌های اصولی و مناسب، جهش صادراتی محصولات کشاورزی شدنی است. سهم صادرات کشاورزی در ارزش افزوده این بخش، مبین ارتباط و حضور آن در بازارهای جهانی است. این شاخص از یک درصد در سال ۱۳۷۰ به ۱۷ درصد در سال ۱۳۸۴ رسیده است (خالدی و رحیم‌زاده، ۱۳۸۷).

۷-۱ ساختار پایان‌نامه

تحقیق حاضر علاوه بر این فصل دارای چهار فصل دیگر است. در فصل دوم به مرور منابع و ادبیات موضوع پرداخته و مطالعات داخلی و خارجی به صورت جداگانه مورد بررسی قرار می‌گیرد. فصل سوم به تشریح روش‌شناسی پژوهش و تصریح مدل‌های اقتصادسنجی مورد استفاده، اختصاص یافته است. در فصل چهارم به برآورد مدل‌ها و تجزیه و تحلیل داده‌ها پرداخته شده و نهایتاً نتایج حاصله تحلیل شده است. فصل پنجم نیز به جمع‌بندی و ارائه پیشنهادها و سیاستی و تکمیلی می‌پردازد.

فصل دوم

مروری بر منابع

۱-۲ مقدمه

در مورد نرخ ارز و تأثیر آن بر پدیده‌های متنوع اقتصادی، ادبیات نسبتاً گسترده داخلی و خارجی وجود دارد. هریک از این مطالعات تلاش داشته‌اند از جنبه‌ای خاص تأثیر نرخ ارز را بر متغیرهای اقتصادی مورد بررسی قرار دهند. در مطالعات اخیر در دنیا که نوسانات نرخ ارز و نااطمینانی حاصل از آن کانون توجه محققین بوده است؛ تأثیر آن بر سطح تولید، میزان سرمایه‌گذاری و حجم تجارت خارجی مورد مطالعه قرار گرفته است. با توجه به هدف مطالعه حاضر که تأثیر نااطمینانی نرخ ارز را بر رشد و تجارت خارجی بخش کشاورزی ایران جستجو می‌کند، در این فصل تلاش شده است مطالعات مرتبط داخلی و خارجی به صورت جامع مورد بررسی قرار گیرند. در حوزه مطالعات خارجی، تحقیقات گسترده‌ای به ارتباط بین نااطمینانی نرخ ارز، سرمایه‌گذاری، رشد و تجارت خارجی به تفکیک بخش‌های اقتصاد و یا کل اقتصاد پرداخته‌اند. در حوزه داخلی، هرچند مطالعاتی در مورد نوسانات نرخ ارز و رابطه آن با سرمایه‌گذاری، رشد و تجارت خارجی برای کل اقتصاد و یا برخی بخش‌ها نیز صورت گرفته است؛ اما در ادبیات مورد بررسی، مطالعه‌ای که به شکل خاص و دقیق تأثیر نااطمینانی نرخ ارز را بر رشد و تجارت خارجی بخش کشاورزی ایران مورد بررسی قرار دهد، یافت نشد. این فصل، علاوه بر مقدمه دارای سه بخش است که در این بخش‌ها به ترتیب مطالعات داخلی و خارجی مربوط به رشد اقتصادی، تجارت خارجی و مدل جاذبه^۱ آورده شده است. مطالعات مربوط به مدل جاذبه به دلیل اهمیت موضوع و گستردگی کاربرد به صورت مجزا آورده شده است.

^۱. Gravity model

۲-۲ مطالعات مربوط به رشد اقتصادی

۲-۲-۱ مطالعات داخلی

عسگری و توفیقی (۱۳۸۸) در مطالعه شناسایی عوامل مؤثر بر نامیزانی نرخ ارز و تأثیر آن بر رشد اقتصادی در ایران از آزمون همگرایی جوهانسون-جوسیلیوس^۱ به منظور برآورد رابطه نرخ تعادلی بلندمدت ارز استفاده نمودند و پس از محاسبه نرخ واقعی تعادلی ارز، از رابطه بلندمدت برآورد شده، نامیزانی به صورت درصد تفاوت میان نرخ واقعی ارز و نرخ واقعی تعادلی ارز برآورد شده، محاسبه گردید. بر اساس یافته‌های این تحقیق، از آنجایی که در اکثر سال‌ها نرخ ارز در کشور بیش از حد ارزش گذاری شده و به عبارتی نامیزانی منفی بوده، مطابق انتظار با قرار گرفتن در مدل رشد، تأثیر منفی بر رشد اقتصادی داشته است. با برآورد مدل مشاهده شد که با افزایش یک درصدی نامیزانی نرخ واقعی ارز، تولید ناخالص ملی ۰/۰۱۲ درصد کاهش می‌یابد. ضریب بدست آمده، معنی‌دار بوده و علامت آن تأییدکننده تأثیر منفی نامیزانی نرخ ارز بر رشد اقتصادی می‌باشد. علاوه بر این، نتایج نشان داد که تأثیر سیاست‌های پولی بر نرخ واقعی ارز در کوتاه‌مدت نسبتاً بالا بوده و موجب نامیزانی کوتاه‌مدت نرخ واقعی ارز می‌شود. بنابراین دولت باید در استفاده از سیاست‌های پولی با احتیاط بیشتری عمل نماید. همچنین بر این نکته تأکید شد که سیاست‌گذاران باید از اتخاذ تصمیماتی که موجب نامیزانی نرخ ارز می‌شود، اجتناب ورزند. ایزدی و ایزدی (۱۳۸۸) اثر تغییرات نرخ ارز مبتنی بر نظریه برابری قدرت خرید بر ارزش افزوده بخش صنعت را بررسی نمودند. به این منظور ابتدا انحراف نرخ واقعی ارز از مسیر تعادلی بلندمدت را با استفاده از نظریه برابری قدرت خرید محاسبه کرده و با توجه به ناپایا بودن برخی از متغیرهای مدل از الگوی خودتوضیح با وقفه‌های گسترده^۲ (ARDL) برای دوره زمانی ۱۳۸۶-۱۳۴۰ استفاده نمودند. طبق نتایج این تحقیق، نوسانات و انحراف نرخ ارز از مسیر تعادلی در کوتاه‌مدت و بلندمدت دارای تأثیر منفی بر رشد ارزش افزوده بخش صنعت است. در پژوهشی مشابه، ایزدی و ایزدی (۱۳۸۷) اثر نوسانات نرخ ارز و انحراف آن از مسیر تعادلی بر ارزش افزوده بخش صنعت در دوره ۱۳۸۶-۱۳۳۸ را با استفاده از مدل کوتانی برای مدل‌سازی انحراف نرخ واقعی ارز از مسیر تعادلی بررسی کردند. نتایج حاصل از این مطالعه نیز حکایت از آن دارد که در کوتاه‌مدت و بلندمدت، نوسانات نرخ ارز تأثیر منفی بر ارزش افزوده بخش صنعت در اقتصاد ایران داشته است. در این راستا ختایی و موسوی‌نیک (۱۳۸۷)، اثر نوسان‌های نرخ ارز بر رشد اقتصادی را با توجه به سطح توسعه بازارهای مالی رصد کردند و از داده‌های تابلویی با به کارگیری میانگین‌های پنج ساله داده‌های

^۱. Johanson & Joselius

^۲. Auto-Regressive Distributed Lag Model

مربوط به ۶۹ کشور نمونه استفاده نمودند. نتایج این پژوهش نشان می‌دهد که بدون در نظر گرفتن سطح توسعه مالی، اثر نوسانات نرخ ارز بر رشد اقتصادی منفی است. ولی با در نظر گرفتن سطح توسعه مالی، این اثر در سطوح پایین توسعه مالی منفی بوده و با افزایش سطح توسعه مالی از حد مشخصی که به اصطلاح سطح آستانه نامیده می‌شود، اثر نوسانات نرخ ارز بر رشد اقتصادی مثبت می‌شود. سطح آستانه توسعه مالی برای همه کشورها ۸۱، برای کشورهای کمتر توسعه یافته مالی ۱۰۶ و برای کشورهای توسعه یافته تر مالی ۷۲ محاسبه شد. این در شرایطی است که شاخص توسعه مالی برای ایران برابر ۳۸ می‌باشد. بنابراین چه سطح آستانه مالی برای کل کشورها در نظر گرفته شود و چه این سطح برای کشورهای کمتر توسعه یافته مالی، در هر صورت سطح توسعه مالی ایران از آن کمتر بوده و نشان می‌دهد که اثر کلی نوسان نرخ ارز بر رشد اقتصادی کشور منفی است. فشاری (۱۳۸۷) به بررسی بی‌ثباتی نرخ ارز واقعی بر تولید ناخالص داخلی ایران پرداخته است. این مطالعه از داده‌های فصلی در دوره ۸۴-۱۳۶۷ و روش‌های واریانس ناهمسانی شرطی اتورگرسیو تعمیم یافته^۱ (GARCH) و جوهانسون-جوسیلیوس استفاده نموده است. نتایج حاصل از تخمین این مدل نشان می‌دهد که بی‌ثباتی نرخ واقعی ارز و نرخ واقعی ارز دارای تأثیر منفی و معنی‌دار بر تولید ناخالص داخلی ایران بوده و متغیرهای رابطه مبادله و حجم نقدینگی واقعی نیز تأثیر مثبت و معنی‌داری بر تولید ناخالص داخلی داشته‌اند. نتایج حاصل از بررسی استحکام مدل نیز بیانگر این است که در تمامی حالت‌های تخمین مدل، تأثیر منفی و معنی‌دار بی‌ثباتی نرخ واقعی ارز بر تولید ناخالص داخلی حفظ شده است. در مطالعه اثر نامتقارن نوسانات نرخ ارز بر تولید و قیمت در ایران توسط کازرونی و رستمی (۱۳۸۶)، در مرحله اول؛ با استفاده از فیلتر هودریک-پرسکات^۲، شوک‌ها را به صورت شوک‌های پیش‌بینی شده و پیش‌بینی نشده و شوک‌های مثبت و منفی نرخ ارز تجزیه و در مرحله بعد آنها بر روی تولید واقعی و قیمت رگرس گردید. نتایج برآورد، حاکی از اثرات نامتقارن نوسانات نرخ ارز بر تولید واقعی و قیمت است و شوک‌های پیش‌بینی شده و پیش‌بینی نشده نرخ ارز به صورت متفاوت از هم بر روی تولید واقعی و سطح قیمت‌ها اثر می‌گذارند. به طوری که شوک‌های پیش‌بینی شده نرخ ارز بیشتر از شوک‌های پیش‌بینی نشده آن، تولید واقعی را دچار نوسان می‌کند. در مورد قیمت نیز عکس این حالت مصداق دارد. همچنین نتایج این مطالعه در مورد اثرات شوک‌های مثبت و منفی نرخ ارز بر روی تولید واقعی و قیمت به این واقعیت منتهی می‌شود که شوک‌های منفی نرخ ارز، تولید واقعی را بیشتر از شوک‌های مثبت آن تحت تأثیر قرار می‌دهد. این در حالی است که شوک‌های مثبت نرخ

1. Generalized Auto-Regressive Conditional Heteroskedasticity

2. Hodrick Prescott filter

ارز روی قیمت بیشتر تأثیرگذار است. در پژوهش قطمیری و شرافتیان (۱۳۸۶)، تأثیر تغییرات نرخ ارز مؤثر اسمی بر تولید ناخالص داخلی حقیقی در کشورهای در حال توسعه منتخب مورد بررسی قرار گرفت. به این منظور دو گروه از کشورها، شامل شش کشور دارای نظام نرخ ارز ثابت و شش کشور دارای نظام نرخ ارز شناور انتخاب شد. طبق نتایج این پژوهش که از رهیافت همجمعی^۱ با داده‌های پانل^۲ (۲۰۰۴-۱۹۸۱) بهره می‌جست، وجود ارتباط بلندمدت بین متغیرها در هر دو گروه از کشورها تأیید شد. برآورد مدل، اثر مثبت کاهش ارزش پول بر تولید را در کشورهای دارای نظام نرخ ارز ثابت تأیید کرد. اما در کشورهای دارای نظام نرخ ارز شناور رابطه‌ی بین نرخ ارز و سطح تولید از لحاظ آماری معنی‌دار نبود. نتایج تحقیق نشان داد که کشورهای دارای نظام نرخ ارز ثابت، باید در کنار سایر سیاست‌های کلان، از سیاست‌های ارزی نیز برای دستیابی به اهداف کلان اقتصادی از جمله افزایش تولید و اشتغال استفاده کنند. مطالعه دیگری توسط حلافی (۱۳۸۶) انجام شده است که در آن تأثیر نامطلوب دو پدیده بی‌ثباتی و انحراف از مقادیر تعادلی نرخ ارز واقعی بر رشد اقتصادی ایران در دوره ۱۳۸۳-۱۳۳۸ مورد بررسی تجربی قرار گرفته است. برای این کار از مدل GARCH برای برآورد شاخص بی‌ثباتی نرخ ارز واقعی و از سه معیار متفاوت (شامل نسبت تفاوت نرخ‌های رسمی و آزاد ارز، معیاری بر اساس نظریه برابری قدرت خرید و معیار دیگر بر اساس مدل ساختاری کوتانی^۳ و همکاران) برای اندازه‌گیری میزان انحراف نرخ واقعی ارز استفاده شد. برازش مدل رشد اقتصادی ایران به وسیله شاخص‌های مختلف، نشان داد که بی‌ثباتی و انحراف نرخ واقعی ارز در تمامی مدل‌ها و بدون وقفه، تأثیر منفی بر رشد اقتصادی ایران دارد. مرادپور و همکاران (۱۳۸۷) در بررسی نوسانات نرخ ارز واقعی و عدم اطمینان حاصل از آن بر سرمایه‌گذاری بخش خصوصی، نااطمینانی نرخ ارز واقعی را از روش GARCH محاسبه کرده، سپس، از آن به عنوان یکی از متغیرهای تأثیرگذار بر سرمایه‌گذاری خصوصی استفاده کرده و مدل نهایی را با استفاده از روش حداقل مربعات معمولی^۴ (OLS) مورد برازش قرار دادند. نتایج نشان داد که افزایش سرمایه‌گذاری دولتی تأثیر مثبتی بر سرمایه‌گذاری خصوصی داشته و عدم اطمینان نرخ ارز واقعی تأثیر منفی قابل توجهی بر سرمایه‌گذاری بخش خصوصی دارد. در نهایت پیشنهاد شد که دولت باید سعی در ثبات نرخ ارز واقعی داشته باشد. در مطالعه مشابهی که توسط کازرونی و دولتی (۱۳۸۶) انجام شد، شاخص نااطمینانی نرخ ارز ناشی از نوسان‌پذیری نرخ ارز واقعی از طریق الگوی GARCH محاسبه گردیده و به عنوان متغیر جایگزین نااطمینانی نرخ ارز

1. Co-integration

2. Panel Data

3. Cottani, J. & et al.

4. Ordinary Least Squares