

جمهوری اسلامی ایران
وزارت جهاد کشاورزی

موسسه پژوهش‌های برنامه‌ریزی،
اقتصاد کشاورزی و توسعه روستایی



بررسی آثار انحرافات ارزی بر بخش کشاورزی

سید صفدر حسینی

۱۳۸۹

بِسْمِ اللّٰهِ الرَّحْمٰنِ الرَّحِیْمِ

گزارش نهایی

طرح:

بررسی آثار انحرافات ارزی بر بخش کشاورزی

مجری:

سید صفدر حسینی

همکاران:

سهیل رضایی، میلاد اتقایی کردکلایی و سمانه ایروانی

۱۳۸۹

فهرست مطالب

فصل اول

۱	مقدمه و اهداف
۱-۱	مقدمه
۲-۱	ضرورت و اهمیت تحقیق
۳-۱	هدف‌های پژوهش
۴-۱	پرسش‌های اصلی و فرعی پژوهش
۵-۱	فرضیه‌های پژوهش
۶-۱	کاربردهای پژوهش
۷-۱	جنبه‌های نوآوری و جدید بودن موضوع

فصل دوم

۸	پیشینه پژوهش
۱-۲	مقدمه
۲-۲	پیشینه پژوهش‌های داخلی
۳-۲	پیشینه پژوهش‌های خارجی
۴-۲	جمع‌بندی

فصل سوم

۱۶	روش پژوهش
۱-۳	مقدمه
۲-۳	متدولوژی محاسبه شاخص برآورد حمایت از تولیدکننده (PSE)
۱۷	الف) شاخص برآورد حمایت از تولیدکننده
۱۸	ب) شاخص حمایت از قیمت بازاری
۱۹	ج) پرداخت‌های بودجه‌ای
۲۰	د) شاخص حمایت درصدی تولیدکننده
۳-۳	متدولوژی محاسبه نرخ ارز تعادلی
۱-۳-۳	مروری بر مبانی نظری و روش‌های تعیین نرخ ارز تعادلی
۲-۳-۳	چارچوب نظری پژوهش حاضر:
۲۵	الف) الگوی نظری
۲۸	ب) ایستایی (پایایی) و ناپایایی (ناپایایی) متغیرها
۳۱	ج) مبانی نظری الگوهای VAR, VARMA و VECM
۳۴	د) تعیین تعداد وقفه بهینه
۳۵	ه) آزمون مرتبه همگرایی
۳۷	و) فیلتر هودریک-پرسکات
۴-۳	متدولوژی بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر شاخص حمایت از تولیدکننده
۵-۳	داده‌های مورد استفاده برای محاسبه PSE
۳۹	الف) قیمت داخلی
۴۰	ب) قیمت مرزی تعدیل‌شده
۴۱	ج) پرداخت‌های بودجه‌ای
۶-۳	مروری بر سیاست‌های ارزی در ایران
۷-۳	جمع‌بندی

نتایج.....	۴۷
۱-۴- مقدمه.....	۴۸
۲-۴- نتایج برآورد و تعیین نرخ ارز تعادلی.....	۴۸
۱-۲-۴- نتایج آزمون ریشه واحد.....	۴۸
۲-۲-۴- نتایج آزمون مرتبه همگرایی.....	۴۹
۳-۲-۴- نتایج برآزش الگوی تصحیح خطا برداری (VEC).....	۵۱
۴-۲-۴- آزمون‌های مربوط به مدل VEC و رابطه بلندمدت.....	۵۷
۳-۴- بررسی سیاست‌های ارزی طی دوره زمانی ۱۳۶۸-۸۶.....	۶۲
الف- بررسی روند نرخ ارز رسمی با واقعی.....	۶۳
ب- بررسی روند نرخ ارز واقعی با تعادلی.....	۶۵
ج- بررسی روند نرخ ارز رسمی با تعادلی.....	۶۶
۴-۴- اثر انحراف نرخ ارز بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده کالاهای منتخب.....	۶۸
۱-۴-۴- گوشت مرغ.....	۶۸
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گوشت مرغ در دوره‌های ارزی.....	۷۰
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گوشت مرغ در دوره‌های ارزی.....	۷۳
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده گوشت مرغ طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۷۴
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده گوشت مرغ طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۷۶
۲-۴-۴- شیر.....	۷۸
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان شیر در دوره‌های ارزی.....	۸۰
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان شیر در دوره‌های ارزی.....	۸۱
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده شیر طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۸۲
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده شیر طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۸۴
۳-۴-۴- گوشت گاو.....	۸۵
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گوشت گاو در دوره‌های ارزی.....	۸۷
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گوشت گاو در دوره‌های ارزی.....	۸۹
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده گوشت گاو طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۹۰
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده گوشت گاو طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۹۲
۴-۴-۴- گندم.....	۹۳
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گندم در دوره‌های ارزی.....	۹۵
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گندم در دوره‌های ارزی.....	۹۷
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده گندم طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۹۸
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان گندم طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۹۹
۵-۴-۴- ذرت.....	۱۰۱
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان ذرت در دوره‌های ارزی.....	۱۰۳
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان ذرت در دوره‌های ارزی.....	۱۰۵

ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده ذرت در برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۰۵
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده ذرت طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۰۷
۴-۴-۶- برنج.....	۱۰۹
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان برنج در دوره‌های ارزی.....	۱۱۱
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان برنج در دوره‌های ارزی.....	۱۱۲
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده برنج طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۱۳
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده برنج طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۱۵
۴-۴-۷- پسته.....	۱۱۶
الف- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان پسته در دوره‌های ارزی.....	۱۱۹
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان پسته در دوره‌های ارزی.....	۱۲۰
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده پسته طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۲۱
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده پسته طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۲۲
۴-۴-۸- خرما.....	۱۲۴
ب- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (نرخ ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکنندگان خرما در دوره‌های ارزی.....	۱۲۷
ج- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز واقعی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده خرما طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۲۷
د- بررسی اثر انحراف نرخ ارز (ارز رسمی) بر شاخص‌های حمایت تولیدکننده خرما طی برنامه‌های توسعه اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی.....	۱۲۹
۴-۵- جمع‌بندی.....	۱۳۱

فصل پنجم

پیشنهادها.....	۱۳۲
۱-۵- جمع‌بندی کلی.....	۱۳۳
الف) برآورد نرخ ارز تعادلی.....	۱۳۳
ب) اثر انحرافات ارزی بر حمایت از تولیدکنندگان محصولات منتخب.....	۱۳۳
۱- گوشت مرغ.....	۱۳۳
۲- شیر.....	۱۳۷
۳- گوشت گاو.....	۱۴۱
۴- گندم.....	۱۴۴
۵- ذرت.....	۱۴۸
۶- برنج.....	۱۵۲
۷- پسته.....	۱۵۵
۸- خرما.....	۱۵۸
۲-۵- پیشنهادها.....	۱۶۱
فهرست منابع.....	۱۶۳

فهرست جداول

جدول	۱-۱: مقادیر نرخ‌های مختلف ارز (ارقام به ریال).....	۴
جدول	۱-۳: آمار و اطلاعات مورد نیاز و منابع تأمین آن.....	۴۶
جدول	۱-۴: نتایج آزمون ADF برای بررسی پایایی متغیرها.....	۴۹
جدول	۲-۴: نتایج آزمون طول وقفه بهینه در الگوی VAR.....	۴۹
جدول	۳-۴: نتایج آزمون همگرایی جوهانسون برای تعیین تعداد روابط بلندمدت در حالت‌های مختلف.....	۵۰
جدول	۴-۴: نتایج آزمون تعیین مرتبه همگرایی جوهانسون در حالت چهارم.....	۵۱
جدول	۵-۴: نتایج برآورد الگو با استفاده از روش VECM.....	۵۲
جدول	۶-۴: مقایسه نتایج تحقیق حاضر با سایر پژوهش‌ها و اثرگذاری متغیرها بر نرخ ارز واقعی.....	۵۴
جدول	۷-۴: نرخ‌های ارز رسمی، واقعی و تعادلی.....	۵۶
جدول	۸-۴: نتایج آزمون نرمال بودن جملات پسماند در رابطه بلندمدت.....	۵۸
جدول	۹-۴: نتایج آزمون نبود همبستگی پایایی میان جملات پسماند.....	۵۸
جدول	۱۰-۴: نتایج آزمون ثبات سیستم الگوی VAR.....	۵۹
جدول	۱۱-۴: نتایج آزمون ناهمسانی واریانس میان جملات پسماند.....	۵۹
جدول	۱۲-۴: نتایج تجزیه واریانس برآورد نرخ ارز تعادلی.....	۶۰
جدول	۱۳-۴: مقادیر نرخ ارز رسمی و واقعی طی دوره ۱۳۶۸-۸۶ (ارقام به ریال).....	۶۳
جدول	۱۴-۴: مقادیر نرخ ارز رسمی، ارز تعادلی و درصد انحراف نرخ ارز رسمی از تعادلی در دوره ۱۳۶۸-۸۶.....	۶۵
جدول	۱۵-۴: مقادیر نرخ ارز رسمی، تعادلی و درصد انحراف نرخ ارز طی دوره ۱۳۶۸-۸۶.....	۶۷
جدول	۱۶-۴: وضعیت تولید و تجارت گوشت مرغ ایران طی دوره ۱۳۶۸-۸۶.....	۶۹
جدول	۱۷-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر مقادیر حمایت از تولیدکنندگان گوشت مرغ (نرخ ارز واقعی).....	۷۱
جدول	۱۸-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر مقادیر حمایت از تولیدکنندگان گوشت مرغ (نرخ ارز رسمی).....	۷۳
جدول	۱۹-۴: مقادیر شاخص‌های حمایت از تولیدکنندگان گوشت مرغ طی برنامه‌های توسعه (ارز واقعی).....	۷۵
جدول	۲۰-۴: مقادیر شاخص‌های حمایت از تولیدکنندگان گوشت مرغ طی برنامه‌های توسعه (ارز رسمی).....	۷۷
جدول	۲۱-۴: وضعیت تولید و تجارت شیر ایران طی دوره ۱۳۶۸-۸۶.....	۷۹
جدول	۲۲-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر مقادیر حمایت از تولیدکنندگان شیر (نرخ ارز واقعی).....	۸۰
جدول	۲۳-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر مقادیر حمایت از تولیدکنندگان شیر (نرخ ارز رسمی).....	۸۱
جدول	۲۴-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر شاخص‌های حمایت از تولیدکنندگان شیر طی برنامه‌های توسعه (نرخ ارز واقعی).....	۸۳
جدول	۲۵-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر شاخص‌های حمایت از تولیدکنندگان شیر طی برنامه‌های توسعه (نرخ ارز رسمی).....	۸۴
جدول	۲۶-۴: وضعیت، تولید، عملکرد و تجارت گوشت گاو طی دوره ۱۳۶۸-۸۶.....	۸۶
جدول	۲۷-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر مقادیر حمایت از تولیدکنندگان گوشت (نرخ ارز واقعی).....	۸۸
جدول	۲۸-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر مقادیر حمایت از تولیدکنندگان گوشت گاو (نرخ ارز رسمی).....	۹۰
جدول	۲۹-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر شاخص‌های حمایت از تولیدکنندگان گوشت گاو طی برنامه‌های توسعه (ارز واقعی).....	۹۱
جدول	۳۰-۴: بررسی اثر انحراف نرخ ارز بر شاخص‌های حمایت از تولیدکنندگان گوشت گاو طی برنامه‌های توسعه (ارز رسمی).....	۹۳