Archive of SID

اقتصاد وکشاورزی/ جلد ۲/ شماره ۳/ صفحات ۱۱۹-۱۳۸

عوامل موثر بر قیمت ها در اقتصاد ایران

محمد عمرانی و جواد ترکمانی*

تاریخ دریافت: ۸۶/۳/۲۱ تاریخ پذیرش: ۸۶/۱۱/۲۳

چکیده

هدف اصلی این مطالعه، بررسی عامل های موثر بر پایداری قیمت های بخش های گوناگون اقتصاد است. داده‌های مورد نیاز شامل متغیرهای نرخ ارز، نرخ بهره، حجم نقدینگی و شاخص قیمت بخش های کشاورزی، صنعت و خدمات طی دوره ی ۱۳۵۰تا۱۳۸۲، از مجموعه داده‌های سری زمانی اقتصادی- اجتماعی موسوم به PDS و مجموعه آمار سری زمانی سازمان برنامه‌ریزی و مدیریت بدست آمده است. از الگوی خود توضیح برداری (VAR) برای برآورد و آزمون واکنش متغیرهای درونزای الگو نسبت به شوک های وارده بر جملات اخلال استفاده شد. بر اساس نتایج مشخص گردید که متغیرهای پولی شامل نرخ ارز، نرخ بهره ، حجم نقدینگی و همچنین قیمت های بخش خدمات بر قیمت های بخش کشاورزی اثر دارند. از سوی دیگر افزایش قیمت های بخش صنعت منجر به افزایش قیمت های کشاورزی میشود. در بخش صنعت مشخص گردید افزایش نرخ بهره، حجم پول و قیمت های کشاورزی تاثیر منفی بر قیمت های این بخش دارند و تنها افزایش قیمت خدمات باعث افزایش قیمت های صنعت میشود. قیمت های بخش خدمات نیز از قیمت های بخش کشاورزی و نرخ ارز به گونه ی منفی و از نرخ بهره، حجم پول و همچنین از قیمت های بخش صنعت به گونه ی مثبت متأثر میشود.

واژه های کلیدی: قیمت، کشاورزی، صنعت، خدمات، الگوی خود توضیح برداری.

* به ترتیب عضو هیئت علمی گروه اقتصاد کشاورزی دانشگاه آزاد اسلامی واحد زابل و استاد گروه اقتصاد کشاورزی دانشگاه شیراز

e-mail: m_omrani82@yahoo.com

www.SID.ir

Archive of SID

پیشگفتار

عملکرد اقتصاد کلان با سه فاکتور کلی میزان تورم، نرخ رشد و میزان بیکاری مورد قضاوت قرار می‌گیرد. هنگامی که تورم بالاست، قیمت کالاهایی که مردم خریداری می‌کنند، افزایش می‌یابد. این یکی از علت های ناخوشایند تورم است؛ حتی اگر درآمد مردم همراه با قیمت ها افزایش یابد. تورم همچنین بدان سبب ناخوشایند است که به تناوب با آشفتگی های دیگر اقتصادی نیز همراه است (دورنبوش و فیشر، ۱۳۸۰).

از مهمترین موارد مطرح در بررسی عامل های موثر بر سیستم قیمت ها، تعیین متغیرهای توضیحی مناسب و بررسی چگونگی ثبات قیمت ها ست. اهمیت ثبات سیستم قیمت ها به اندازه‌ای است که از آن می‌توان به عنوان یکی از معیارهای مهم ارزیابی سیستم اقتصادی یک کشور نام برد (تفضلی، ۱۳٦٦). اگر سیستم قیمت ها دارای ثبات باشد، می‌توان سیاست های کلان اقتصادی را بر مبنای آن تنظیم نمود. در غیر این صورت تاثیر سیاست های اتخاذ شده قابل پیش‌بینی نبوده و این سیاست ها کارایی لازم را در اقتصاد نخواهد داشت.

سیاست های پولی از جمله مهمترین سیاست هایی است که می‌تواند بر قیمت های بخش های گوناگون اقتصاد، از جمله قیمت مسکن، کالاهای مصرفی بادوام، خدمات، صنعت و کشاورزی موثر باشد. بررسی ادبیات این سیاست ها نیز نشان می‌دهد که در ابتدای دهه ی ۱۹۸۰ بر اثر افزایش قیمت نفت قیمت ها در کشورهای صنعتی تحت تاثیر قرار گرفت (ایساک و همکاران، ۱۹۹۷).

در رابطه با تاثیرگذاری حجم نقدینگی بر قیمت ها، پولگرایان بر این باورند که جهت رابطه علی[1] از عرضه ی پول به قیمت ها ست (دورنبوش و فیشر، ۱۳۸۰). با این حال، در مطالعات دیگر این رابطه ی یک سویه بین عرضه ی پول و قیمت ها مورد تردید قرار گرفته است. در این راستا می‌توان به مطالعات فرنکل (۱۹۷۷)، جونز (۱۹۸۹) و بلتاس و جونز (۱۹۹۳) اشاره نمود که در آنها به روابط دوسویه بین عرضه ی پول و قیمت ها اشاره شده است. نتایج این مطالعات نشان داد که حجم نقدینگی نیز تحت تاثیر سطوح قیمت ها قرار دارد و موجب شده که دو متغیر یاد شده از یکدیگر متاثر باشند.

---

1 - Causality Relation

www.SID.ir

Archive of SID

براساس دیدگاه نخست ،ا فزایش حجم پول بر سطح قیمت ها اثر گذاشته و منجر به تورم می‌گردد. در شرایط تورمی به دلیل پایین بودن کشش درآمدی سیستم مالیاتی، تاخیر طولانی در جمع آوری مالیات و کارا نبودن دستگاه مالیاتی در کشورهای در حال توسعه، درآمدهای دولت همگام با مخارج دولت افزایش نمی‌یابد، درنتیجه تورم باعث کسری بودجه و یا تشدید آن گردیده و به استقراض از بانک مرکزی، افزایش بیشتر حجم پول و افزایش بیشتر قیمت ها منجر می‌گردد(تروی ثیک، ۱۳۶۲).

براساس دیدگاه دوم مقامات پولی برای جلوگیری از فشارهای طرف عرضه، از قبیل شوک ناشی از کاهش عرضه پول، و به منظور جبران کاهش درآمد واقعی، جلوگیری از ایجاد رکود و کاهش احتمالی اشتغال، به گونه ی منفعل عرضه ی پول را افزایش خواهند داد. بدین ترتیب در شرایط تورم ناشی از فشار هزینه، افزایش قیمت باعث افزایش عرضه پول می‌گردد (تروی ثیک، ۱۳۶۲).

فیگ و پیرس (۱۹۷۶)، با استفاده از آمار ماهیانه و فصلی دوره ی ۱۹۵۳-تا۱۹۷۱ برای هر یک از متغیرهای نرخ رشد شاخص قیمت عمده فروشی، نرخ رشد M_1[۱]، نرخ رشد M_2[۲] و نرخ رشد MB[۳] الگوهای ARIMA[۴] مناسبی برآورد و با استفاده از آزمون ها-پیرس [۵] وجود رابطه ی علی بین سری های تورم و رشد حجم پول را مورد ارزیابی قرار داده‌اند. نتایج این مطالعه، رابطه‌ای را بین سری های مورد مطالعه نشان نداد.

لوئیس (۱۹۹۳)، در بررسی رابطه ی دلار آمریکا با مارک آلمان و ین ژاپن، با استفاده از روش VAR و از راه توابع واکنش ضربه‌ای اثر شوک بر متغیرهای گوناگون پولی را طی دوره‌ی ۱۹۸۵ تا ۱۹۹۰ مورد بررسی قرار داد. متغیرها نماینده ی سیاست های پولی، M_1 و ذخیره‌های احتیاطی و اندوخته‌های دولتی بود. براساس یافته‌های این مطالعه مشخص شد که سیاست های پولی انبساطی منجر به کاهش ارزش واحد پول داخلی شده است.

۱- تعریف محدود پول
۲- تعریف گسترده پول
۳- پایه پولی

4 - Auto Regressive Integrated Moving Average
5 - Ha-Pears Test

www.SID.ir

Archive of SID

اوزاتای (۲۰۰۰)، در مطالعه‌ای با استفاده از یک مدل اقتصاد سنجی به بررسی تورم در کشور ترکیه که دارای اقتصادی با بدهی و تورم بالا ست، پرداخت. مدل مورد استفاده او یک مدل پولی نامتعادل بود که می‌توانست نتایج سناریوهای تثبیت گوناگون را مورد تحلیل قرار دهد. نتایج نشان داد که بدون رفع ناهماهنگی‌های اقتصادی در سطح کلان، اقدام در راستای ثابت نگه داشتن نرخ ارز و یا محدود کردن انبساط پولی به منظور کنترل تورم بی‌ثمر است.

کاپورال و همکاران (۲۰۰۱)، در مطالعه‌ای به منظور کنترل بهینه ی تورم با استفاده از روش حداکثر واریانس تصادفی به بررسی واکنش های ناشی از شوک قیمتی موقت، در کشورهای گوناگون پرداختند. نتایج نشان داد که هماهنگی در کاهش اثر ضربه (شوک) در بیشتر موارد تورم را کنترل کرده و هزینه‌ها را کاهش می‌دهد.

در ایران نیز دو دیدگاه رایج بوده است، شمار زیادی از اقتصاددانان افزایش حجم پول را علت اصلی افزایش قیمت ها می‌دانند و برخی نیز بر این باورند که تورم در ایران ساختاری است و تنگناهای موجود در بخش های بازرگانی خارجی، کشاورزی و بودجه دولت از عوامل عمده تورم است. بر این اساس به برخی مطالعات انجام شده اشاره می‌شود:

از جمله مطالعاتی که نظریه ی پولی بودن تورم را تایید می‌کنند، می‌توان به مطالعات دادخواه (۱۹۸۵)، نیلی (۱۳٦٤) و طباطبایی (۱۳۷۰) اشاره کرد. نتایج این مطالعات نظریه پولگرایان را تایید کرده و تاکید بر پولی بودن تورم در ایران دارد. این در حالیست که بر اساس مطالعات لونی (۱۹۸۵)، سوری (۱۳۷۱) و نصر اصفهانی و یاوری (۱۳۸۲) به منظور کنترل تورم در ایران نمی‌توان صرفاً بر سیاست های پولی اتکا کرد. چرا که بایستی بر نقش عامل‌های ساختاری و فشار هزینه بر سطح عمومی قیمت ها نیز توجه داشت و بخش واقعی اقتصاد را نیز در نظر گرفت.

در این مطالعه، با توجه به اهمیت نقش قیمت ها در اقتصاد ایران، عامل های موثر بر قیمت های بخش های گوناگون اقتصاد و تاثیر اختلال در متغیرهای اثرگذار بر این قیمت ها مورد بررسی قرار گرفت. در این رابطه، از متغیرهای نرخ ارز، نرخ تورم و حجم نقدینگی به عنوان متغیرهای تاثیرگذار بر قیمت ها استفاده شد.

www.SID.ir

Archive of SID

روش پژوهش

در این مطالعه از داده‌های سری زمانی نرخ ارز، نرخ بهره، حجم نقدینگی و شاخص قیمت بخش های کشاورزی، صنعت و خدمات در ایران طی دوره ۱۳۵۰ تا ۱۳۸۲ استفاده شد. این داده‌ها از مجموعه داده‌های سری زمانی اقتصادی- اجتماعی موسوم به PDS و مجموعه‌ی آمار سری زمانی سازمان برنامه و بودجه بدست آمده است. به منظور برآورد مدل و انجام آزمون‌های مربوطه از بسته‌های نرم افزاری Eviews 3 و Microfit 4.1 استفاده گردید.

به منظور تشخیص پایایی متغیرهای سری زمانی از آزمون های دیکی- فولر [۱] و دیکی- فولر تعمیم یافته در قالب روش نه مرحله‌ای ارائه شده از سوی صدیقی و همکاران (۲۰۰۰)، استفاده شد. همچنین برای متغیرهای ناپایا، ابتدا آزمون وجود شکست ساختاری به روش پرون[۲] (۱۹۸۹) انجام شد تا در صورت نبود شکست ساختاری، با تعیین درجه ی پایایی متغیرها، از روش مناسب برای برآورد استفاده شود.

در این مطالعه به بررسی تاثیر متغیرهای نرخ ارز، نرخ تورم و حجم نقدینگی بر قیمت‌های بخش های صنعت، خدمات و کشاورزی با استفاده از الگوی VAR پیشنهادی از سوی سیمز [۳] (۱۹۸۰)پرداخته شده و پس از آن واکنش متغیرهای درونزای الگو نسبت به شوک‌های وارده بر جملات اخلال با استفاده از توابع عکس العمل تحریک مورد آزمون قرار گرفت.

چنانچه Y_t برداری از متغیرهای سری زمانی باشد که بتوان آنرا توسط وقفه‌هایش به صورت یک فرآیند خود توضیح میانگین متحرک ARMA الگو سازی کرد، آنگاه می‌توان نوشت:

$$Y_t = \Phi_1 Y_{t-1} + ... + \Phi_p Y_{t-p} + u_t + \theta_1 u_{t-1} + ... + \theta_q u_{t-q}$$

که در آن ماتریس های $\Phi_1 .....\Phi_p$ و $\theta_1 .....\theta_q$ در بردارنده ی پارامترها و u_t بردار مربوط به جملات اخلال است. همچنین k شمار متغیرهای درونزا و p شمار وقفه‌های متغیر می‌باشد. به گونه ی معمول برآورد چنین الگویی نسبتاً دشوار است. یک فرآیند خود توضیح چند متغیره به صورت زیر نوشته می‌شود:

1- Dickey-Fuller Test
2- Perron
3- Simes

www.SID.ir

Archive of SID

$$Y_t = \Phi_1 Y_{t-1} + ... + \Phi_p Y_{t-p} + U_t$$

این روش به الگوی خود توضیح برداری یا VAR معروف است. که در آن Y_t و وقفه‌های آن و همچنین U_t بردارهای $k \times 1$ و Φ_iها $(i = 1,...., p)$ ماتریس های $k \times k$ ضرایب الگو هستند. چنین الگویی در قالب یک شکل حل شده است چرا که هر متغیر در Y_t براساس وقفه‌های خود آن متغیر و وقفه‌های سایر متغیرهای درون الگو توضیح داده می‌شود(نوفرستی، ۱۳۷۸).

یک مسئله در رابطه با الگوی VAR تعیین شمار وقفه‌هایی است که بایستی در الگو ظاهر شوند. این مهم از راه ضوابط آکائیک[1] (AIC) و شوارتز- بیزین[2] (SBC) امکان‌پذیر است. در چنین الگویی روش OLS[3] یک روش کارا در برآورد ضرایب هر یک از معادلات سیستم می‌باشد، چرا که تمامی متغیرهای سمت راست کلیه معادلات، متغیرهای از پیش تعیین شده و به گونه‌ی کامل همانند هستند (نوفرستی، ۱۳۷۸).

توابع عکس العمل تحریک، واکنش متغیرهای درونزای الگو را نسبت به شوک های وارده بر جملات اخلال بیان می‌کند. در مدل ساده خود توضیح برداری (رابطه ۲) تغییر در u_i باعث تغییر ناگهانی در Y_t خواهد شد. لذا، توابع عکس العمل تحریک، اثر شوکی به اندازه یک انحراف معیار را روی مقادیر جاری و آتی متغیرهای درونزا نشان می‌دهد. شکل کلی توابع عکس العمل تحریک به صورت زیر می‌باشد:

$$\Phi(L)Y_t = U_t$$

که در آن:

$$\Phi(L) = I + \Phi_1 L + \Phi_2 L^2 + ... + \Phi_p L^p$$

مدل بالا یک مدل خود توضیح از مرتبه p و L در آن عملگر وقفه می‌باشد. در صورتی که $\Phi(L)$ را معکوس کنیم، مدل بالا به صورت یک مدل میانگین متحرک خود توضیح در می‌آید.

1- Akaike Information Criterion
2- Schwarz Bayesian Criterion
3- Ordinary Least Square

www.SID.ir

Archive of SID

$$Y_t = \Phi(L)^{-1}U_t = \sum_{s=0}^{\infty}\beta_s U_{t-s}$$

در صورتی که قدر مطلق ریشه‌های دترمینان ماتریس $\Phi(L)^{-1}$ کوچکتر از یک باشد، می‌توان نتیجه گرفت که الگو دارای ثبات می‌باشد(نوفرستی، ۱۳۷۸).

نتایج و بحث

از آنجا که در این مطالعه از آمار سالانه ی متغیرهای نرخ ارز، نرخ بهره، حجم نقدینگی و شاخص قیمت بخش های کشاورزی، صنعت و خدمات در ایران طی دوره - ۱۳۵۰ تا ۱۳۸۲ برای برآورد الگو استفاده گردید، از آزمون ریشه ی واحد جهت نشان دادن درجه ی پایایی متغیرها استفاده شد که نتایج آن در جدول (۱) خلاصه شده است:

جدول (۱) نتایج آزمون پایایی متغیرهای مورد استفاده

نام متغیر	آماره دیکی‌فولر	مقدار بحرانی	مرتبه پایایی
نرخ ارز	-۲/۲۹	-۱/۹۵	I(0)
نرخ بهره	-۲/۸	-۲/۶۲	I(0)
حجم نقدینگی	-۳/۶۹	-۲/۶۳	I(0)
شاخص قیمت بخش کشاورزی	-۳/۵۵	-۲/۱۸	I(0)
شاخص قیمت بخش صنعت	-۳/٤٥	-۲/۶۳	I(0)
شاخص قیمت بخش خدمات	-٤//٤٦	-۲/۶۳	I(0)

مأخذ: یافته‌های پژوهش

نتایج حاصل از آزمون پایایی متغیرها که در جدول (۱) آمده است، نشان می‌دهد که این متغیرها پایا از مرتبه صفرهستند، لذا امکان استفاده از روش VAR پیشنهاد شده از سوی سیمز (۱۹۸۰) امکان پذیر شد. با استفاده از این روش می‌توان روابط بین متغیرهای مدل را به گونه‌ی همزمان بررسی کرد.

به منظور برآورد الگوی VAR ابتدا می‌بایست شمار وقفه ی بهینه ی الگو تعیین گردد. بدین منظور بر اساس دو معیار آکائیک (AIC) و شوارتزبیزین (SBC) به تعیین شمار وقفه‌ی بهینه پرداخته شد. در تعیین وقفه ی بهینه باید دو نکته در نظر گرفته شود. نخست اینکه شمار

www.SID.ir

Archive of SID

وقفه باید به اندازه‌ای بزرگ باشد تا جزء اخلال معادلات تا حد امکان دچار خودهمبستگی نباشد و دوم اینکه شمار پارامترهای تخمینی بیش از حد درجه آزادی را کاهش ندهد (صدیقی و همکاران، ۲۰۰۰). نتایج حاصل از آزمون انتخاب مرتبه VAR در جدول (۲) نشان داده شده است.

جدول (۲) نتایج آزمون انتخاب مرتبه VAR

رتبه	آکائیک (AIC)	شواتزبیزین (SBC)
٤	-٨٤٣/٣٥٧٨	-٩١٧/٤٨٣٦
٣	-٧٦٣/٦٢٥٥	-٨٤٧/٦٩٧٤
٢	-٨٨٤/٦٨٥١	-٩٤٣/٥٣٥٤
١	-٩٦٩/٦٨٤٣	-١٠٠٣/٣
٠	-١١٥٩/٩	-١١٨٨/٣

مأخذ: یافته‌های پژوهش

بر مبنای نتایج جدول (۲) دو معیار آکائیک و شواتز بیزین در رتبه ی سه بیشینه می‌شوند. بنابراین وقفه ی بهینه به منظور برآورد مدل برابر سه انتخاب گردید.

برآورد مدل VAR برای قیمتهای بخش کشاورزی

در جدول (۳) نتایج حاصل از برآورد مدل VAR برای قیمت های بخش کشاورزی آمده است.

همان گونه که از نتایج جدول (۳) برمی‌آید، وقفه ی سوم متغیر نرخ ارز تاثیری منفی و به لحاظ مقداری برابر با ۰/٦٦٣٩٦- بر قیمت های کشاورزی دارد. بنابراین انتظار می‌رود که با افزایش نرخ ارز قیمت های کشاورزی کاهش یابد. افزون بر این متغیر یاد شده در سطح معنی‌داری ۵ درصد دارای اهمیت آماری است. بر اساس مبانی نظری انتظار میرود افزایش نرخ ارز منجر به افزایش قیمت های کشاورزی شود ، اما در نتایج به دست آمده خلاف این روند دیده میشود. با توجه به آمارههای ارایه شده میتوان گفت که الگوی برآورد شده دچار خودهمبستگی و تورش تصریح نمیباشد. افزون بر این براساس مقادیر بردارهای ویژه نیز

www.SID.ir

Archive of SID

مشخص گردید که هم خطی میان متغیرهای مستقل چندان بالا نمیباشد. در خصوص تأثیر نرخ ارز میتوان این فرضیه را مطرح نمود که ممکن است در پاسخ به افزایش نرخ ارز و افزایش صادرات تولید داخل بسیار بیشتر از افزایش صادرات تحریک شود، به گونهای که

جدول (۳) نتایج حاصل از بر آورد مدل VAR برای قیمت های بخش کشاورزی

نام متغیر		ضرایب	خطای معیار
C	عرض از مبدأ	۳۰٦/۹۱۰۷	۲۷۵/۷۷۱۱
E(-1)	وقفه ی نخست نرخ ارز	۰/۱۵۹۸۱	۰/۱٤۳۷۱
E(-2)	وقفه ی دوم نرخ ارز	۰/۲۲۷۷٤	۰/۲۸۹٦۲
E(-3)	وقفه ی سوم نرخ ارز	-۰/٦٦۳۹٦**	۰/۲۲۳٦٤
R(-1)	وقفه ی نخست نرخ بهره	-۳۹/٤۱٤۸	۲۵/۱۳۳۸
R(-2)	وقفه ی دوم نرخ بهره	٤٤/۳۵٦٦*	۲۱/٦۸٦۱
R(-3)	وقفه ی سوم نرخ بهره	-٤۵/۷۹۱٤**	۲۰/۵۲٤۹
M(-1)	وقفه ی نخست حجم نقدینگی	-۰/۰۱۷۳٦۳**	۰/۰۰۷٦۸۹۱
M(-2)	وقفه ی دوم حجم نقدینگی	-۰/۰۰۹٤۳۰۰	۰/۰۱٤۹۵۵
M(-3)	وقفه ی سوم حجم نقدینگی	۰/۰٤۷۹۵۳	۰/۰٤۲۲۸۷
PA(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت کشاورزی	-۲/۰۷۰۳**	۰/۸۲۳۳٤
PA(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت کشاورزی	-۰/۲۰۳٦٤	۰/۹۰۱۵۲
PA(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت کشاورزی	۰/٤۷۲۳٤	۰/٦۸۵۳۳
PI(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت صنعت	۰/۰۷۹۵۷۸	۱/۵۱۹۹
PI(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت صنعت	۱/۹۱۹٦	۲/٦۹۵۷
PI(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت صنعت	۷/۲۰۲٤*	۳/۸۲٤٦
PS(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت خدمات	۹/۲۰۸۷*	۵/۰۷۱٦
PS(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت خدمات	-۱۰/۸۸۷۳*	۵/۱۷۲۲
PS(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت خدمات	۰/۱۹۰۰٤	٤/۱۲۹۸
T	روند زمانی	۱۹/٤٤۸۵**	۸/۰۱۱۹
آمارهها	R2		F
	۰/۹۹۸		۳۲٤/۰۰۲۳ ***

* و**و *** به ترتیب معنیدار در سطح ۱۰ درصد، ۵ درصد و ۱درصد میباشد

مأخذ: یافتههای پژوهش

www.SID.ir

Archive of SID

میزان عرضه به بازار داخلی محصولات کشاورزی نیز به گونه ی شایان توجهی افزایش یافته باشد. سیاست های دولت و به سخنی دیگر دخالت های دولت در بازار محصولات و نهاده‌های کشاورزی نیز میتواند از دیگر دلایل وقوع رابطه خلاف مبانی نظری باشد.

وقفه‌های دوم و سوم متغیر نرخ بهره نیز به لحاظ آماری معنی‌دار است. وقفه ی دوم متغیر نرخ بهره بر قیمت های کشاورزی تاثیری مثبت داشته و مقدار ضریب آن برابر با ٤٤/٣٥٦٦ می‌باشد که در سطح معنی‌داری ۱۰ درصد معنی‌دار بوده و وقفه ی سوم متغیر نرخ بهره دارای تاثیری منفی بر قیمت های کشاورزی بوده و ضریب مربوط به آن برابر با ٤٥/٧٩١٤- می‌باشد و در سطح معنی‌داری۵ درصد دارای اهمیت آماری است. البته ، روی هم رفته مجموع اثر وقفههای معنی دار نرخ بهره بر قیمت های کشاورزی را میتوان بسیار ناچیز ارزیابی نمود. صرفنظر از اثرگذاری ناچیز نکته ی مهم دیگر نهادی یا دستوری بودن نرخ بهره است که این امر نیز ممکن است مانع دست یافتن به الگویی مبتنی بر مبانی نظری باشد.

متغیر معنی‌دار دیگر وقفه ی نخست حجم نقدینگی است که هرچند تاثیری اندک به لحاظ مقداری (۰/۰۱۷۳٦۳) دارد، اما علامت آن منفی می‌باشد و در سطح معنی‌داری ۵ درصد به لحاظ آماری معنی‌دار است. البته، اثر منفی حجم نقدینگی بر قیمتهای کشاورزی بسیار ناچیز است. هم اکنون بخش های صنعت و خدمات در مقایسه با بخش کشاورزی پیشروتر ند در نتیجه انتظار میرود به دلیل عدم وجود ارتباط مؤثر میان بخش کشاورزی و سایر بخش ها که به بیان دیگر نوعی از دوگانگی را در بر می گیرد ، افزایش نقدینگی در بخش های نامبرده جذب شده و منجر به افزایش قیمت این بخش ها گردیده و به گونه ی نسبی تقاضا در این بخش ها را بیشتر تحریک نماید و با توجه به اینکه در فعالیت های سرمایه گذاری که انتظار میرود پس از افزایش حجم نقدینگی افزایش یابد ، در بخش کشاورزی محدودتر است. افزون بر این گفتنی است که در سال های اخیر افزایش قیمت کالاهای بخش های صنعت و خدمات بسیار بیشتر از بخش کشاورزی بوده است و به این ترتیب به گونه ی نسبی رابطه ی مبادله به زیان بخش کشاورزی تغییر یافته است و این امر باعث شده تا با وجود افزایش حجم نقدینگی تقاضا برای کالاهای کشاورزی و درنتیجه قیمت های این بخش را تحت تأثیر قرار ندهد.

همچنین وقفه ی نخست قیمت های کشاورزی تاثیری منفی بر قیمت های این بخش داشته و مقدارضریب مربوطه برابر با ۲/۰۷۰۳ می‌باشد که متغیر یاد شده در سطح ۵ درصد به لحظ آماری معنی‌دار شده است. متغیر معنی‌دار دیگر وقفه ی سوم قیمت های بخش صنعت

www.SID.ir

Archive of SID

است که دارای تاثیری مثبت بر قیمت های کشاورزی بوده و مقدار ضریب مربوط به آن برابر با ۷/۲۰۲٤ می‌باشد و در سطح ۱۰ درصد دارای اهمیت آماری است . افزایش قیمت صنعت از راه افزایش سود این بخش و افزایش سرمایه گذاری میتواند امکان افزایش تولید این بخش و درنتیجه افزایش بکارگیری کالاهای سایر بخش ها که به عنوان کالاهای واسطه و نهاده در بخش صنعت استفاده میشود را فراهم کند. در بخش صنعت ایران نیز به ویژه صنایع غذایی از تولیدات کشاورزی بیشتر استفاده میکنند.

افزون بر این وقفه‌های نخست و دوم متغیر قیمت های بخش خدمات نیز در سطح ۱۰درصد معنی‌دار شده‌اند که وقفه ی نخست دارای ضریب ۹/۲۰۸۷ بوده و تاثیری مثبت بر قیمت های کشاورزی دارد و وقفه ی دوم به لحاظ مقدار مطلق دارای ضریب ۱۰/۸۸۷۳ می‌باشد که تاثیری منفی بر قیمت های کشاورزی دارد. مجموع اثر متغیرهای با وقفه قیمت خدمات بر قیمت های کشاورزی چندان شایان توجه نیست.

متغیر معنی‌دار دیگر ، متغیر روند زمانی است که می‌توان آن را به مثابه افزایش تقاضا برای محصولات کشاورزی تلقی نمود. این متغیر دارای ضریب ۱۹/٤٤۸۵ بوده و تاثیری مثبت بر قیمت های کشاورزی دارد و در سطح معنی‌داری ۵ درصد به لحاظ آماری معنی‌دار شده است.

روی هم رفته مشاهده شد که قیمتهای بخش کشاورزی از متغیرهای کلان اقتصاد ایران یا به گونه‌ی خلاف آنچه مبانی نظری به آن اشاره دارند ، متأثر می شوند و یا اینکه ارتباط مبتنی بر مبانی نظری چندان قابل ملاحظه نیست. بر اساس مبانی اقتصادسنجی و از نظر تأمین فرض ها میتوان گفت الگوهای مورد استفاده قابل قبول و مطلوب هستند، اما از جهت علامت و یا به بیانی دیگر نوع رابطه میان متغیرهای کلان اقتصاد ایران و قیمت های بخش کشاورزی رابطه ی مبتنی بر مبانی نظری مشاهده نشد. در این خصوص میتوان گفت ممکن است این روابط حاکی از نوعی عدم ارتباط میان بخش کشاورزی و سایر بخش ها باشد. این نبود ارتباط افزون بر شرایط خاص اقتصاد میتواند از دخالت گسترده دولت در بخش کشاورزی نیز ناشی شود .

تاثیر قیمت های بخش صنعت نیز مثبت و به لحاظ مقدار مطلق بالا ست. این در حالی است که قیمت های بخش کشاورزی از قیمت های بخش خدمات به گونه ای مستمر تاثیر نمی‌پذیرد چراکه در مواقعی که قیمت ها به دلیل پدیده تارعنکبوتی پایین می‌آید، قیمت‌های بخش خدمات نیز به آن دامن زده و منجر به کاهش بیش از حد قیمت‌های این بخش می‌شود

www.SID.ir

Archive of SID

که دلیل این امر می‌تواند فاصله ی بین بخش کشاورزی و بخش خدمات در ایران باشد. . در مورد اثر معنی‌دار و مثبت متغیر روند زمانی نیز گفتنی است که این متغیر می‌تواند بیانگر افزایش تقاضا برای محصولات کشاورزی در نتیجه ی عامل هایی همچون افزایش جمعیت و یا افزایش درآمد باشد که این دو عامل نیز می‌توانند منجر به افزایش قیمت ها شوند.

مهمترین نکته درخور توجه بزرگی مقدار مطلق ضریب متغیر روند زمانی است که حاکی از آن است که مهمترین عامل تاثیرگذار بر قیمت های کشاورزی افزایش تقاضا برای محصولات این بخش است. وجود رابطه ی مثبت میان بخش های صنعت و کشاورزی حاکی از تعامل میان این دو بخش می‌باشد، بدین ترتیب جهت‌گیری‌های مبتنی بر توسعه صنعتی می‌تواند شرایط تولید در بخش کشاورزی را نیز بهبود بخشد.

برآورد مدل VAR برای قیمت های بخش صنعت

در جدول (٤) نتایج حاصل از برآورد مدل VAR برای قیمت های بخش صنعت آمده است.

همان گونه که از نتایج جدول (٤) مشخص است، وقفه ی نخست متغیر نرخ بهره تاثیری منفی و به لحاظ مقداری ١٦/٦٦٥٤- بر قیمت های بخش صنعت داشته است و انتظار می‌رود که با افزایش نرخ بهره قیمت های بخش صنعت کاهش یابد. افزون بر این ، متغیر یاد شده در سطح ١٠ درصد دارای اهمیت آماری است. با افزایش نرخ بهره سرمایه‌گذاری کاهش خواهد یافت و با توجه به اینکه سرمایه‌گذاری موازی کاهش تقاضای محصولات صنعتی خواهد بود، لذا این نتایج مبتنی بر انتظارات است. گفتنی است که در نتیجه ی افزایش نرخ بهره ، هزینه ی تولید محصول و درنتیجه قیمت محصول افزایش و در نهایت تقاضا برای محصول کاهش خواهد یافت. این کاهش در تقاضا برای محصول همراه با افزایش هزینه ی تولید میتواند منجر به کاهش بیشتر سود سرمایهگذاری و کاهش سرمایهگذاری گردد. وقفه ی دوم حجم نقدینگی دارای تاثیری منفی و به لحاظ مقداری ٠/٠١٣٢٧٢- بوده و در سطح ٥ درصد معنی‌دار است. در این خصوص میتوان گفت اگر افزایش حجم نقدینگی از راه کاهش نرخ بهره و افزایش سرمایهگذاری در پروژه های زود بازده منجر به افزایش تولید بخش صنعت شود، انتظار می رود با افزایش تولید و عرضه ی محصولات صنعتی قیمت های این بخش کاهش یابد.

www.SID.ir

Archive of SID

جدول (٤) نتایج حاصل از تخمین مدلVAR برای قیمت های بخش صنعت

نام متغیر		ضرایب	خطای معیار
C	عرض از مبدأ	۷۷/۷۸۵۹	۹۹/۹۸۷۱
E(-1)	وقفه ی نخست نرخ ارز	-۰/۰۶۳۵٤۲	۰/۰۵۲۱۰۷
E(-2)	وقفه ی دوم نرخ ارز	۰/۱٦۵٦۹	۰/۱۰۵۰۱
E(-3)	وقفه ی سوم نرخ ارز	-۰/۰۷۸۰۲۹	۰/۰۸۱۰۸٤
R(-1)	وقفه ی نخست نرخ بهره	-۱٦/٦٦۵٤*	۹/۱۱۲۸
R(-2)	وقفه ی دوم نرخ بهره	۱۰/۱۰۰٤	۷/۸٦۲۸
R(-3)	وقفه ی سوم نرخ بهره	-٦/۲٦۱٦	۷/٤٤۱۸
M(-1)	وقفه ی نخست حجم نقدینگی	-۰/۰۰۳۳۷۸۵	۰/۰۰۲۷۸۷۹
M(-2)	وقفه ی دوم حجم نقدینگی	-۰/۰۱۳۲۷۲**	۰/۰۰۵٤۲۲٤
M(-3)	وقفه ی سوم حجم نقدینگی	۰/۰۲۳٦۳٦	۰/۰۱۵۳۳۲
PA(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت کشاورزی	-۰/۸۷۹۰۷**	۰/۲۹۸۵۲
PA(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت کشاورزی	-۰/۸۱۰٤٦**	۰/۳۲٦۸۷
PA(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت کشاورزی	۰/۰۱٤٦۰۸	۰/۲٤۸٤۸
PI(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت صنعت	۱/۳۹۳۹**	۰/۵۵۱۰۸
PI(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت صنعت	-۲/۵۳۰۵**	۰/۹۷۷۳۷
PI(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت صنعت	۱/۷٦۷۵	۱/۳۸٦۷
PS(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت خدمات	٤/۱۳۷۰**	۱/۸۳۸۸
PS(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت خدمات	۱/٦۰۰۰	۱/۸۷۵۳
PS(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت خدمات	-۲/۵۲٦۷	۱/٤۹۷٤
T	روند زمانی	۷/۲۳٤۳**	۲/۹۰٤۹
	R^2		F
	۰/۹۹۹		۷۷۲/۵٦۱۹ ***

* و**و *** به ترتیب معنی‌دار در سطح ۱۰ درصد، ۵ درصد و ۱درصد می‌باشد
مأخذ: یافته‌های پژوهش

وقفه‌های نخست و دوم قیمت های بخش کشاورزی نیز دارای تاثیری منفی و به لحاظ مقداری به ترتیب دارای ضرایب ۰/۸۷۹۰۷- و ۰/۸۱۰٤٦- بوده و در سطح ۵ درصد دارای

www.SID.ir

Archive of SID

اهمیت آماری هستند.به گونه ی معمول قیمت محصولات کشاورزی دارای نوسانات سیکلی است و حتی در برخی از دورهها این نوسان به صورت یک کاهش بیش از یک دوره است از این رو اگر در یک دوره قیمت محصولات کشاورزی در سطح بالا باشد در پی این تغییر انتظار میرود در دوره یا دورههای بعد، تولید افزایش و قیمت کاهش یابد و بخش صنعت از این کاهش قمت سود برده و بتواند با هزینهی پایین محصولات این بخش را به عنوان نهاده استفاده نماید. انتظار میرود با افزایش تقاضا برای کالاهای صنعتی در این بخش قیمتهای صنعت نیز افزایش یابد. اما با این حال ممکن است با گسترش تقاضا برای محصولات صنعتی امکان بهرهگیری از صرفهجویی ناشی از مقیاس تولید و نیز کاهش هزینه فراهم و قیمتها در این بخش کاهش یابد، اما به هرحال این رابطه نیاز به تعمق و تامل بیشتر دارد. وقفه ی نخست قیمت های بخش صنعت تاثیری مثبت و وقفه دوم آن تاثیری منفی بر قیمتهای این بخش دارد. همانند آنچه در مورد قیمت های کشاورزی عنوان شد، اگر در یک دورهی مشخص قیمت های بخش صنعت افزایش و این امر منجر به ورود بیشتر به این بخش شود، به گونهای که با این ورود در طی دو دوره تولید بخش صنعت افزایش یابد، آنگاه کاهش قیمت به گونه ی طبیعی رخ خواهد داد. همچنین وقفه ی نخست قیمتهای بخش خدمات تاثیری مثبت بر قیمت های بخش صنعت دارد که ضریب مربوطه ٤/١٣٧ میباشد و در سطح ٥ درصد معنیدار شده است. اگر افزایش قیمت های خدمات همراه با افزایش تقاضا برای محصولات صنعتی در این بخش باشد، رابطه ی بالامورد انتظار خواهد بود.

متغیر روند زمانی که نماینده ی افزایش تقاضا برای محصولات صنعتی است نیز تاثیری مثبت بر قیمت های صنعت دارد و در سطح اطمینان ٥ درصد معنیدار شده است. مقدار ضریب مربوط به این متغیر برابر با ٧/٢٣٤٣ میباشد. همان گونه که ملاحظه گردید ، نرخ ارز تاثیر معنیداری بر قیمت های بخش صنعت ندارد که این امر ناشی از حمایت دولت از صنعت داخلی از راه ثابت نگه داشتن نرخ ارز میباشد. تاثیر منفی نرخ بهره بر قیمت های بخش صنعت میتواند به دلیل کاهش سرمایهگذاری یا افزایش نرخ بهره و رکود ناشی از آن در این بخش باشد. حجم نقدینگی بر قیمتهای بخش صنعت در دوسال نخست تاثیری منفی دارد، ولی پس از گذشت سه سال اثر افزایش حجم نقدینگی مثبت و تشدید میشود. با توجه به بزرگی مقدار ضریب متغیر روند زمانی میتوان دریافت که مهمترین عامل تاثیرگذار

www.SID.ir

Archive of SID

بر قیمت های صنعت افزایش تقاضا برای محصولات این بخش در جریان توسعه اقتصادی است.

برآورد مدل VAR برای قیمت های بخش خدمات

در جدول (۵) نتایج برآورد مدل VAR برای قیمتهای بخش خدمات است.

جدول (۵) نتایج حاصل از برآورد مدلVAR برای قیمت های بخش خدمات

نام متغیر		ضرایب	خطای معیار
C	عرض از مبدأ	٦٤/٢٣٤٦	٥١/٩٦٤٢
E(-1)	وقفه ی نخست نرخ ارز	-٠/٠٢٨٣٥٩	٠/٠٢٧٠٨٠
E(-2)	وقفه ی دوم نرخ ارز	٠/٠٥٨٥٤٦	٠/٠٥٤٥٧٣
E(-3)	وقفه ی سوم نرخ ارز	-٠/٠٨٥٣٢٧*	٠/٠٤٢١٤٠
R(-1)	وقفه ی نخست نرخ بهره	-١١/١٩١١**	٤/٧٣٦٠
R(-2)	وقفه ی دوم نرخ بهره	٩/٣١٤١**	٤/٠٨٦٤
R(-3)	وقفه ی سوم نرخ بهره	-٦/٠٤٣٢	٣/٨٦٧٦
M(-1)	وقفه ی نخست حجم نقدینگی	-٠/٠٠٢٦٧٩٤*	٠/٠٠١١٤٨٩
M(-2)	وقفه دوم حجم نقدینگی	-٠/٠٠٥٩٤٩٠*	٠/٠٠٢٨١٨١
M(-3)	وقفه ی سوم حجم نقدینگی	٠/٠٢٠٠٤٣**	٠/٠٠٧٩٦٨٣
PA(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت کشاورزی	-٠/٤١٨١٤**	٠/١٥٥١٥
PA(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت کشاورزی	-٠/٢٢٩٣٩	٠/١٦٩٨٧
PA(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت کشاورزی	٠/١١٣٦٠	٠/١٢٩١٤
PI(-1)	وقفه ی نخست شاخص قیمت صنعت	١/٢٠٧٧***	٠/٢٨٦٤٠
PI(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت صنعت	-٠/٣٥٨٠٧	٠/٥٠٧٩٥
PI(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت صنعت	١/٦٥١٨**	٠/٧٢٠٦٨
PS(-1)	وقفه نخست شاخص قیمت خدمات	١/٤٧٠٤	٠/٩٥٥٦٥
PS(-2)	وقفه ی دوم شاخص قیمت خدمات	-٠/٩١٥٦٣	٠/٩٧٤٦١
PS(-3)	وقفه ی سوم شاخص قیمت خدمات	-١/٠٥٣٢	٠/٧٧٨١٩
T	روند زمانی	٤/٠٠٢٦**	١/٥٠٩٧
	R^2		F
	٠/٩٩٩		٣٠٢٢/٠٠ ***

* و**و *** به ترتیب معنی‌دار در سطح ۱۰ درصد، ۵ درصد و ۱درصد می‌باشد

مأخذ: یافته‌های پژوهش

www.SID.ir

Archive of SID

وقفه سوم متغیر نرخ ارز بر قیمت های بخش خدمات تاثیری منفی داشته و مقدار ضریب مربوط به آن برابر با ۰/۰۸۵۳۲۷- می‌باشد، بنابراین انتظار می‌رود که با افزایش نرخ ارز قیمت‌های بخش خدمات کاهش یابد. البته ، نرخ ارز نیز در اغلب دورههای مورد مطالعه چند نرخی بوده است و این علامت ممکن است ناشی از این عامل باشد. افزون بر این متغیر یاد شده در سطح معنی‌داری ۱۰ درصد دارای اهمیت آماری است. وقفه‌های نخست و دوم نرخ بهره نیز در سطح ۵ درصد معنی‌دار و به ترتیب دارای تاثیر منفی و مثبت بر قیمت های بخش خدمات دارد. ضرایب مربوط به وقفه‌های این متغیر به ترتیب برابر با ۱۱/۱۹۱۱- و ۹/۳۱۴۱ می‌باشد. که در کل می‌توان تاثیر این متغیر را منفی تلقی کرد. خدمات در بخش خصوصی بیشتر با تغییرات در بخش های دیگر دچار تغییر میشود. به این ترتیب کانال اثرگذاری نرخ بهره ممکن است از راه تغییر در متغیرهای کلان در دیگر بخش ها باشد. افزایش نرخ بهره باعث کاهش سرمایه گذاری و درنتیجه رکود در فعالیت های سرمایهگذاری خواهد شد و این کاهش در سرمایهگذاری رکود در تقاضا برای خدمات را در پی خواهد داشت. همچنین وقفه‌های نخست و دوم حجم نقدینگی به لحاظ آماری در سطح ۱۰ درصد معنی‌دار ند و با در نظر گرفتن اثر هر سه وقفه میتوان گفت افزایش نقدینگی تاثیری مثبت بر قیمت های خدمات دارند . افزایش نقدینگی باعث کاهش نرخ بهره و در ادامه از راههای مکانیزمی که برای نرخ بهره عنوان شد منجر به افزایش قیمت های بخش خدمات خواهد شد. ضرایب مربوط به وقفه‌های این متغیر برابر با ۰/۰۰۲۶۷۹٤- و ۰/۰۰۵۹٤۹- می‌باشد. این در حالی است که وقفه‌ی سوم حجم نقدینگی دارای تاثیری مثبت و به لحاظ مقداری برابر با ۰/۰۲۰۰٤۳ می‌باشد و در سطح ۵ درصد دارای اهمیت آماری است. اثر این متغیر را در مجموع مثبت می‌توان ارزیابی نمود. از سوی دیگر وقفه ی نخست قیمت های کشاورزی تاثیری منفی بر قیمت های بخش خدمات دارد . همان گونه که از نظر اهمیت مصرف مشخص است، کالاهای کشاورزی در مقایسه با خدمات از ضرورت مصرف بالایی برخوردارند و این امر باعث می‌شود که با افزایش قیمت های کشاورزی تقاضا برای خدمات کاهش و درنتیجه قیمت‌های بخش خدمات کاهش یابد. ضریب مربوط به آن برابر با ۰/٤۱۸۱٤- است و در سطح ۵ درصد دارای اهمیت آماری است .

این در حالی است که قیمت های بخش صنعت تاثیری مثبت بر قیمت های بخش خدمات دارد و ضرایب مربوط به وقفه‌های نخست و سوم آن به ترتیب برابر با ۱/۲۰۷۷ و

www.SID.ir

Archive of SID

۱/٦٥۱۸ است. متغیر معنی‌دار دیگر، متغیر روند زمانی است که بیانگر افزایش تقاضا برای محصولات این بخش می‌باشد، از راه افزایش قیمت محصولات بخش خدمات در طول دوره نمودار می‌شود که در سطح ۵ درصد معنی‌دار شده است. ضریب مربوط به این متغیر برابر ٤/۰۰۲٦ می‌باشد. همان گونه که ملاحظه گردید نرخ ارز تاثیری منفی دارد. از سوی دیگر، نرخ بهره بر قیمت های بخش خدمات اثر منفی دارد که این امر می‌تواند دلیلی بر ناکارآمدی سیستم بانکی ایران باشد که تاکنون نتوانسته به گونه ای هدفمند و با برنامه بر فعالیت های اقتصادی تاثیرگذار باشد.

از سوی دیگر، بخش صنعت دارای تاثیری مثبت بر قیمت های بخش خدمات بوده و این حاکی از آن است که این دو بخش رابطه ا ی نزدیک با یکدیگر داشته وبا رونق بخش صنعت و افزایش قیمت های آن در بخش خدمات نیز قیمت ها افزایش می‌یابد ، که البته این نیز می‌تواند از راه افزایش تقاضا برای کالاهای بخش خدمات صورت گیرد. همان گونه که ملاحظه شد، قیمت‌های بخش خدمات از قیمت های سال های گذشته‌ی این بخش تاثیر نگرفته و این بخش بیشتر از قیمت سایر بخش‌ها و متغیرها تاثیر می‌پذیرد. در نهایت قیمت‌های بخش خدمات از افزایش تقاضا برای ارائه ی خدمات از سوی این بخش تاثیر می‌پذیرد که با توجه به بزرگی ضریب متغیر روند زمانی می‌توان دریافت که عامل تاثیرگذار مهمی بر قیمت‌های خدمات می‌باشد. با توجه به ماهیت کالاهای بخش خدمات این افزایش در گذر زمان مورد انتظار است. زیرا کالاهای این بخش نسبت به سایر بخش‌ها از تنوع مطلوب تری برخوردار است و میزان تحولات در این بخش بیش از سایر بخش‌های اقتصاد است.

نتیجه‌گیری و پیشنهادها

در این مطالعه به منظور بررسی عامل های موثر بر ثبات قیمت‌ها در ایران، تاثیر عمده‌ترین عوامل تاثیرگذار بر قیمت ها، در هریک از بخش های گوناگون اقتصاد از جمله متغیرهای نرخ ارز، نرخ بهره، حجم نقدینگی و همچنین قیمت سایر بخش‌ها با استفاده از الگوی VAR مورد بررسی قرار گرفته است. از آنجا که افزایش تقاضا در طول زمان یکی از عامل های موثر بر قیمت‌های هر بخش اقتصادی می‌باشد، لذا یک متغیر روند به عنوان نماینده‌ی تغییرات تقاضا در طول زمان برای محصولات هر بخش در مدل لحاظ گردید.

www.SID.ir

Archive of SID

نتایج حاصل از برآورد الگوی VAR حاکی از آن بود که نرخ ارز بیشتر تاثیری منفی و نسبتاً کوچک بر قیمت های بخش های گوناگون اقتصاد دارد. که البته در مورد بخش صنعت این تاثیر معنی‌دار نیست و این امر به دلیل حمایت از صنایع داخلی می‌باشد که از جانب دولت صورت می‌گیرد. نرخ بهره تاثیری روشن و مشخص بر قیمت بخش های گوناگون اقتصاد نداشته و دربرخی سال ها دارای تاثیری مثبت و در برخی سال ها تاثیری منفی بر قیمت بخش های گوناگون دارد که این امر به دلیل ناکارامدی و نا هدفمند بودن برنامه‌های نظام بانکی در ایران است. نقدینگی بر قیمت های بخش کشاورزی و صنعت اثری منفی و بر قیمت های بخش خدمات اثر مثبت دارد. البته ، در مورد این متغیر باید توجه داشت که می‌تواند از راه تاثیرگذاری متغیرهای دیگری همچون نرخ بهره نیز بر متغیرهای قیمت تاثیرگذار باشد.

نتایج حاصل از تاثیرپذیری قیمت بخش ها از یکدیگر نشان داد که قیمت های کشاورزی با قیمت‌های بخش صنعت دارای رابطه ی مثبت ، ولی با قیمت های بخش خدمات رابطه ی مشخصی ندارد. دلیل این امر می‌تواند فاصله ی بین بخش کشاورزی و خدمات در ایران باشد. همچنین قیمت های کشاورزی با وقفه‌های مربوطه به صورت سیکلی تأثیر مثبت و منفی دارد که به نظر می‌رسد دلیل آن افزایش قابل ملاحظه عرضه در سال های پس از افزایش قیمت است. قیمت بخش های صنعت و خدمات با یکدیگر رابطه ا ی مثبت و هر دوی آنها با قیمت‌های بخش کشاورزی رابطه ی منفی دارند. با این وجود قیمت های بخش صنعت از قیمت‌های سال های گذشته این بخش به گونه ی مثبت تاثیر می‌پذیرد، در حالی که بخش خدمات از قیمت‌های سال های گذشته ی این بخش تاثیر نمی‌گیرد. البته ، درخور توجه است که عامل های انتقال دهنده ی تابع تقاضا همچون جمعیت یا افزایش درآمد در جریان توسعه، افزایش بزرگتری را در قیمت های هر کدام از بخش ها در پی داشته است. در نهایت با توجه به یافته‌های این مطالعه لزوم افزایش کارایی سیستم بانکی، تقویت رابطه بخش کشاورزی با بخش های صنعت و خدمات به منظور مدرنیزه کردن بخش کشاورزی از راه ایجاد صنایع تبدیلی و بازارهای محصول و همچنین پرهیز از اعمال سیاست‌هایی که موجب افزایش حجم نقدینگی می‌گردد توصیه می‌شود، چرا که حجم نقدینگی می‌تواند از راه اثرگذاری بر متغیرهای دیگری همچون نرخ بهره ، بر قیمت بخش های گوناگون تاثیرگذار باشد.

www.SID.ir

Archive of SID

منابع

تروی ثیک، ج. ا. (۱۳٦۲)، تورم راهنمایی بر بحران در تئوری اقتصاد معاصر، ترجمه حسین عظیمی و حمید رضا غفارزاده، تهران: موسسه امیر کبیر.

تفضلی، ف (۱۳٦٦)، اقتصاد کلان: نظریه‌ها و سیاستهای اقتصادی، نشر نی.

دائی کریم زاده، سعید (۱۳۷٤)، پول، تورم و علیت با شواهد تجربی ایران، ۷۱-۱۳٦٤، دانشگاه شیراز، رساله کارشناسی ارشد.

سوری، داوود (۱۳۷۱)، یک الگوی پیوسته زمانی برای اقتصاد ایران، دانشگاه شیراز، رساله کارشناسی ارشد.

دورنبوش، ر. و ا. فیشر (۱۳۸۰)، اقتصاد کلان، ترجمه محمد حسین تیزهوش تابان، انتشارات سروش.

طباطبایی یزدی، رویا (۱۳۷۰)، بررسی تورم در ایران به روش معادلات همزمان با تاکید بر انتظارات تورمی، دانشگاه تهران، رساله کارشناسی ارشد.

طیب نیا، علی (۱۳۷۲)، تورم ساختاری در ایران، دانشگاه تهران، رساله دکتری.

نصراصفهانی، ر. و ک. یاوری(۱۳۸۲)، عوامل اسمی و واقعی موثر بر تورم در ایران: رهیافت خودرگرسیون برداری VAR. فصلنامه پژوهشهای اقتصادی ایران.۱٦(۳):۹۹-٦۹.

نیلی، مسعود (۱۳٦٤)، بررسی آثار افزایش حجم پول بر نظام اقتصادی کشور در دو دهه اخیر، برنامه و توسعه، شماره سوم، دوره اول، ص ۱۱۹-۸۹ .

نوفرستی، محمد(۱۳۷۸)، ریشه واحد و همجمعی در اقتصاد سنجی، موسسه خدمات فرهنگی رسا.

Aghevli, B. B., M. Khan (1978), Government Deficits and the Inflationary Process in Developing Countries, IMF staff papers, 25: 383-415.

Beltas, A., T. Jones, (1993), Money, inflation and causality in a financially repressed economy: Algeria, 1970-88, Applied Economics, 25: 473-480.

Caporale, G. M., M. Chui, S. G. Hall, B. Henry (2001), Coordination and price shocks: an empirical analysis, Economic Modeling, 18: 569-584.

Dadkhah, K. M. (1985), The Inflationary process of the Iranian economy: 1970-1980, Int. J. Middle East Stud, 17: 365-381.

Feige, E. L., D. K. Pearce (1976), Economically ratipnal expectations: Are innovations in the rate of inflation independent of innovations in measures of monetary and fiscal policy? Journal of Political Economy, 84: 499-522.

www.SID.ir

Archive of SID

Fiorencio, A., A. R. B. Moreira (2001), Measuring the stability of the price system, Economic Modeling, 18: 381-397.

Frenkel, J. A. (1977), The forward exchange rate, expections an demand for money: The German hyperinflation, American Economic Review, 67: 653-70.

Issac, A. G., D. E. Rapach (1997), Monetary shocks and relative farm prices: A re-examination. Amer. J. Agr. Econ.37: 1332-39.

Jones, J. D. (1989), A comparison of lag length selection techniques in tests of Granger Causality between money growth and inflation: Evidence for the USA, 1959-86, Applied Economics, 21: 809-822.

Jones, J. D., N. Uri, (1987), Money inflation and causality: Another look at the empirical evidence for USA, 1953-84, Applied Economics, 19: 619-634.

Lewis, K. K. (1993), Are foreign exchange intervention and monetary policy related and does it really matter? NBER Working Paper. 4377.

Looney, R. G. (1985), The inflationary process in prerevolutionary Iran, The Journal of Developing Area, 19: 329-350.

Ozatay, F. (2000), A quarterly macroeconometric model for a highly inflationary and indebted country: Turkey, Economic Modeling, 17: 1-11.

Seddighi, H., K. Lawler, A. Katos (2000), Econometric: A Practical approach, Routledge, London.

www.SID.ir