

بررسی تاثیرپذیری قیمت محصولات کشاورزی از نااطمینانی تورمی

مصطفی گودرزی، رضا رستمیان مهسا تسلیمی¹

تاریخ پذیرش: 1391/5/5

تاریخ دریافت: 1390/10/23

چکیده

ایران بی ی که با آن می ی ایران بی ی مشکل کشور ی تاثیرپذیری کشاورزی، ارزش افزوده بخش کشاورزی در مصرف کننده، ارزش افزوده بخش کشاورزی، ارزش واقعی ارز، حجم نقدینگی، نااطمینانی تورمی و ناگهانی قیمت محصولات کشاورزی به تکانه نااطمینانی تورمی و قیمت مصرف کننده، در کوتاه که این که نااطمینانی تورمی، روش GARCH، روش خودرگرسیون برداری

JEL: C51 C53 E31 Q11

های کلیدی: کشاورزی، نااطمینانی تورمی، روش GARCH، روش خودرگرسیون برداری

جوی کارشناسی ارشد، گروه اقتصاد کشاورزی، دانشگاه آزاد اسلامی

به ترتیب استادبار

Email: goodarzi1979@yahoo.com

کشاورزی یک

نیازهای غذایی جمعیت رو به رشد کشور اهمیت زیادی در برنامه .

این بخش، حدود 15% تولید ناخالص داخلی و یک پنجم کل شاغلان کشور را دارد 80% محصولات غذایی مورد نیاز داخلی را تامین می‌کند (حاجیان و همکا 86). افزایش در تولید ناخالص داخلی، سبب افزایش تقاضای کالا و خدمات و کاهش آن نیز به کاهش تقاضا برای کالا و خدمات منجر می . تقاضای اضافی می‌تواند سبب افزایش تولید برای برآوردن تقاضا و یا افزایش در قیمت کالاها و خدمات در نتیجه (کیتسو ولی به ی 2006). تورم می دلیل تولیدکننده، مصرف‌کننده و سرمایه‌گذار در آینده شکل گیرد. در اقتصادهای ملتهب نیز افزایش فعالی تجاری بازار بورس باعث تشدید رشد ی (لی به ی 2000). افزایش تورم منجر به کاهش سودآوری فعالی تولیدی و تعدیل نیروی کار نیز می . افزایش بیکاری منجر به کاهش درآمد قابل تصرف، کاهش تقاضای کالا و خدمات و در نتیجه در شرایط کاهش نیافتن تولید، منجر به ایجاد مازاد کالا و خدمات می . ترکیب دست‌مزدهای پایین، افزایش بیکاری، افزایش شاخص بهای کالاها و خدمات مصرفی چرخه‌ی رکود اقتصادی را نشان می (مقدسی و باغستانی، 1389). ی زیادی را بر جامعه تحمیل می‌کند. ی

صاحبان دارایی و به زیان مزد- یران، افزایش نااطمینانی و بی‌ثباتی در اقتصاد کلان کوتاه‌تر شدن افق زمانی تصمیم‌گیری و کاهش سرمایه ی تولیدی و در نتیجه کاهش رشد اقتصادی می (پیرایی و دادور، 1390). آشکار که تورم می‌تواند بیش‌تر به عنوان مقیاسی برای بازگویی وضعیت کلی کلان اقتصادی در و از طرفی نوسان و انحراف اجزای غیرقابل پیش‌بینی آن می بی‌ثباتی و نااطمینانی وضعیت کلان اقتصادی . یی که به گستردگی برای کمّی کردن وضعیت بی‌ثباتی کلان اقتصادی و تقریب آن کار می سرانجام به یافتن مقیاسی

گیری نااطمینانی تورمی و متغیر توصیف‌کننده وضعیت بی‌ثبات کلان اقتصادی منجر می (1994)

نااطمینانی تورمی در سال اخیر در جایگاه شاخصی برای نشان دادن وضعیت بی‌ثباتی کلان اقتصادی به کار گرفته شده است. متغیرهای بخش شاخص قیمت محصولات کشاورزی از وضعیت بی‌ثباتی اقتصادی و نوسان ها تاثیرپذیر . همین علت، این مطالعه رابطه میان شاخص قیمت محصولات کشاورزی با نااطمینانی تورمی را بررسی کرده است. مطالعات متعددی در این زمینه صورت از جمله یزدان نقدی (1387) تاثیرات افزایش تولید بخش کشاورزی، خدمات و صنعت را بر تورم در ایران به روش خودتوضیح با وقفه (ARDL) بررسی کرده . نتایج نشان د که برای کنترل تورم در ایران، ضروری است دولت در سی اقتصادی خویش توجه بیش به قیمت و گسترش تولید در بخش کشاورزی و خدمات . پیری و همکاران (1388) با استفاده از روش واریانس ناهم‌سان شرطی خودرگرسیو تعمیم یافته (GARCH)¹ و مدل خود توضیح با وقفه توزیعی (ARDL) عوامل مؤثر بر قیمت محصولات کشاورزی را با تاکید بر تورم و نااطمینانی تورمی بررسی کردند. نتایج به دست آمده گویای وجود رابطه جمعی میان متغیرهای مدل و آثار متغیر نااطمینانی تورمی بر سطح قیمت محصولات کشاورزی یک متغیر جدید در کنار دیگر متغیرها، معنی . مقدسی و باغستانی (1389)

جمعی یوهانسون² و تصحیح خطای برداری ارتباط علی میان نرخ تورم و تغییرپذیری نسبی قیمت کالاهای کشاورزی شناسایی کردند. نتایج به دست آمده نشان که در کوتاه مثبت و معنی‌داری میان تورم و تغییرپذیری قیمت نسبی کالاهای کشاورزی دت، تنها متغیر تورم تاثیر مثبت و معنی‌دار بر تغییرپذیری قی

¹ Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (GARCH)

² Johansen cointegration test

نسبی دا .

(1389) به بررسی پویایی

نداشتن اطمینان تورمی پرداختند. به طور کلی این محققان نتیجه گرفتند که سری تورم اقتصاد ایران حافظه (بستگی بلندمدت) و آثار هر تکانه بر این سری تا دوره طولانی باقی می . جعفری صمیمی و مؤتمنی (2009)¹ با استفاده از آزمون علیت گرنجر ارتباط میان تورم و نااطمینانی تورمی بررسی کرد . نتایج مطالعه نشان د که تورم در ایران منجر به نااطمینانی تورمی بیش می شود، اما روابط معکوس معنادار نیست.

ی (2010)² روابط تصادفی میان نرخ تورم، نرخ رشد تولید، نااطمینانی تورمی و نااطمینانی تولید برای ده کشور مرکزی و شرقی در حال انتقال اروپایی بررسی کردند. نتایج د که نرخ تورم نااطمینانی را مورد نرخ تورم و نرخ رشد تولید تحریک می - کند و این ی اقتصادی واقعی زیان . به عبارت دیگر، نرخ رشد تولید، نااطمینانی در اقتصاد کلان را کاهش می .

این مطالعه بررسی تاثیرپذیری سطوح قیمتی محصولات کشاورزی از نااطمینانی رمی است. به همین منظور از متغیرهای کلان اقتصادی و روش خودرگرسیون برداری (VAR) برای انجام این بررسی بهره گرفته شده است. ی

1353-1386 ی شیوه بانک مرکز

ی EVIEWS 6 ی . گفتنی است که

ی نیز در این زمینه انجام گرفته است. کرباسی و پیری (1387)

زمانی 1350-1383 به بررسی موضوع موردنظر به وسیله

ARDL GARCH جمعی پ

¹ Jafari samimi and Motameni (2009).

² Hasanov and Omay (2010).

روش تحقیق

طورکلی مدل ساختاری و غیر برای پیش‌بینی به شیوه زمانی به کار می‌رود. رگرسیون تک می و

زمان است، در حالی که مدل غیر

آینده متغیرها به وسیله خطایی که پیش‌بینی‌پذیر نیست، تعیین می‌شود. این مدل تکنیک باکس-جنکینز استفاده شده است (حمیده پور و همکاران، 1389).

VAR⁴ (خودرگرسیون برداری)

ARIMA¹ AR² MA³ که در آن

(IU) می‌باشد. یافته

(GARCH) می‌باشد. یافته

یک ARIMA می‌کند. این جا q

P⁵ ARCH GARCH می‌باشد. یافته

(p,q) می‌باشد. یافته

$$y_t = x_t' \lambda + \varepsilon_t \quad (1)$$

$$\varepsilon_t^2 = \omega + \sum_i \alpha_i \varepsilon_{t-i}^2 + \sum_j \beta_j \varepsilon_{t-j}^2 \quad (2)$$

ε_t : x_t : y_t : t

¹ Auto Regressive Integrated Moving Average
² Auto Regressive
³ Moving Average
⁴ Vector Auto regressive
⁵ Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (ARCH)

باکس جنکیه می یه یه
 آکائیک¹ یه یه یه
 آکائیک یه یه

روش خودرگرسیون برداری یک گزینه در کنار روش باکس جنکینز است که به (گجراتی و ابریشمی، 1385).

شدید کریستوفر سیمز قرار گرفت و گزینه VAR سیمز (1980) پیشنهاد شد.

نظر وی تئوری نمی یه لازم را برای شناسایی مدل

(سیمز وهمکاران، 1990). VAR یک متغیرهای درون

متغیر درون می دیگر متغیرهای

زای مدل توضیح داده می . دو سری زمانی X_t Y_t برای دو متغیر به صورت زیر (نوفرستی، 1389):

$$X_t = a_0 + \sum_{j=1}^k B_j X_{t-j} + \sum_{i=1}^n \lambda_j Y_{t-i} + u_{1t} \quad (6)$$

$$Y_t = a_0 + \sum_{j=1}^k A_j X_{t-j} + \sum_{i=1}^n \lambda_j Y_{t-i} + u_{2t} \quad (7)$$

VAR OLS برآورد زده می این مدل به متغیرهای وارد

شده و طول وقفه بستگی دارد. در ارتباط با ایستایی متغیرهای مورد بررسی، وجود متغیرهای نایستا احتمال ایجاد رگرسیون کاذب و روابط هم باستگی را تشدید می کند، پس باید در مدل

VAR که شامل سر نایستا است وجود بردار یا بردارهای

(VAR) یه یه یه یه یه یه یه

1. یه یه یه یه یه یه یه

¹ Akaike Information Criterion (AIC)

2. VAR مانند پیش

می یی ی ی ی . این جا یی (یی 1386).

VAR (8) m متغیر به صورت رابطه (9) نوشته می :

$$Y_t = + A_1 Y_{t-1} + \dots + A_k Y_{t-k} + v_t = + \sum_{j=1}^k A_j Y_{t-j} + v_t \quad (8)$$

$$Y_t = \sum_{j=1}^k A_j Y_{t-j} + v_t \quad (9)$$

برای ساده کردن عرض از مبدأ حذف می . فرض بر این است که متغیرهای آن مرتبه گرای 1 یا 0 . الگوی بالا نیز به صورت:

$$Y_t = B Y_{t-1} + \sum_{j=1}^{k-1} B_j Y_{t-j} + v_t \quad (10)$$

نوشته می شود که در آن:

$$B = -(I - A_1 - A_2 - \dots - A_k) \quad (11)$$

$$B_j = -(A_{j+1} - A_{j+2} - \dots - A_{j+k}) \quad j = 1, 2, 3, \dots, k-1 \quad (12)$$

شبهه یک تصحیح که متغیرهای

گرای 1 متغیرهای Y_{t-j} ایستا . گرای میان متغیرها نتیجه ایستا $B Y_{t-1}$ می کرد.

این پژوهش و با بررسی مطالعات داخلی و خارجی انجام شده در این خصوص به صورت زیر :

$$LN(API) = \beta_0 + \beta_1 LN(\square)[AVA] + \beta_2 LN(OPEN) + \beta_3 LN(RER) + \beta_4 LN(M_2) + \beta_5 LN(CPI) + IU + u \quad (13)$$

1376 که در آن API کشاورز

OPEN 1376 کشاورز AVA

یکی

$$\sigma_t^2 = 0.000603 + 0.7562 \sigma_{t-1}^2 \quad (16)$$

GARCH (1,0) . ی کافی
 GARCH ی تامین ی کند ی این که
 GARCH ی که ی GARCH کوچک 1
 تکانه ی
 0/75 (کوچک 1) . (همکاران، 1388) کافی
 1 ی که ی
 GARCH ی که ی
 ی تامین کرده .
 ی ی ی یکی ی .
 (2) .
 (2) . ی ی ی ی ی
 کشاورز

ی ی	ی		ی		ی
	-5/21				
	-3/64		تغییر در عرض		IU
ایستا	-2/95	بحرانی			
	-2/61				

شرایطی که ضریب مقدار واریانس
 معنی نباید این نتیجه
 کرد، زیرا ضریب
 پایداری

ی که ی

یک بیشترین

LR¹ یا یی کائیک (AIC) - (SBC)

کوئی (HQ) .

کم 120 یی (1388)

(3)

کشاورز VAR (3)

(1 1)	-12/91
(1 2)	-12/92
(1 3) *	-17/34

این جا ی بهینه (1 3) یی

یوهانسون ی

بیشترین 2 ی

بیشترین ی که ی

ی که ی

(4)

¹ Likelihood ratio

² Trace

³ Maximum Eigen value

(4). $\hat{\beta}_1$ $\hat{\beta}_2$ $\hat{\beta}_3$ $\hat{\beta}_4$ $\hat{\beta}_5$ $\hat{\beta}_6$ $\hat{\beta}_7$ $\hat{\beta}_8$ $\hat{\beta}_9$ $\hat{\beta}_{10}$ $\hat{\beta}_{11}$ $\hat{\beta}_{12}$ $\hat{\beta}_{13}$ $\hat{\beta}_{14}$ $\hat{\beta}_{15}$ $\hat{\beta}_{16}$ $\hat{\beta}_{17}$ $\hat{\beta}_{18}$ $\hat{\beta}_{19}$ $\hat{\beta}_{20}$ $\hat{\beta}_{21}$ $\hat{\beta}_{22}$ $\hat{\beta}_{23}$ $\hat{\beta}_{24}$ $\hat{\beta}_{25}$ $\hat{\beta}_{26}$ $\hat{\beta}_{27}$ $\hat{\beta}_{28}$ $\hat{\beta}_{29}$ $\hat{\beta}_{30}$ $\hat{\beta}_{31}$ $\hat{\beta}_{32}$ $\hat{\beta}_{33}$ $\hat{\beta}_{34}$ $\hat{\beta}_{35}$ $\hat{\beta}_{36}$ $\hat{\beta}_{37}$ $\hat{\beta}_{38}$ $\hat{\beta}_{39}$ $\hat{\beta}_{40}$ $\hat{\beta}_{41}$ $\hat{\beta}_{42}$ $\hat{\beta}_{43}$ $\hat{\beta}_{44}$ $\hat{\beta}_{45}$ $\hat{\beta}_{46}$ $\hat{\beta}_{47}$ $\hat{\beta}_{48}$ $\hat{\beta}_{49}$ $\hat{\beta}_{50}$ $\hat{\beta}_{51}$ $\hat{\beta}_{52}$ $\hat{\beta}_{53}$ $\hat{\beta}_{54}$ $\hat{\beta}_{55}$ $\hat{\beta}_{56}$ $\hat{\beta}_{57}$ $\hat{\beta}_{58}$ $\hat{\beta}_{59}$ $\hat{\beta}_{60}$ $\hat{\beta}_{61}$ $\hat{\beta}_{62}$ $\hat{\beta}_{63}$ $\hat{\beta}_{64}$ $\hat{\beta}_{65}$ $\hat{\beta}_{66}$ $\hat{\beta}_{67}$ $\hat{\beta}_{68}$ $\hat{\beta}_{69}$ $\hat{\beta}_{70}$ $\hat{\beta}_{71}$ $\hat{\beta}_{72}$ $\hat{\beta}_{73}$ $\hat{\beta}_{74}$ $\hat{\beta}_{75}$ $\hat{\beta}_{76}$ $\hat{\beta}_{77}$ $\hat{\beta}_{78}$ $\hat{\beta}_{79}$ $\hat{\beta}_{80}$ $\hat{\beta}_{81}$ $\hat{\beta}_{82}$ $\hat{\beta}_{83}$ $\hat{\beta}_{84}$ $\hat{\beta}_{85}$ $\hat{\beta}_{86}$ $\hat{\beta}_{87}$ $\hat{\beta}_{88}$ $\hat{\beta}_{89}$ $\hat{\beta}_{90}$ $\hat{\beta}_{91}$ $\hat{\beta}_{92}$ $\hat{\beta}_{93}$ $\hat{\beta}_{94}$ $\hat{\beta}_{95}$ $\hat{\beta}_{96}$ $\hat{\beta}_{97}$ $\hat{\beta}_{98}$ $\hat{\beta}_{99}$ $\hat{\beta}_{100}$

کشاورز

%95	ی %95		$\hat{\beta}_1$	$\hat{\beta}_2$
0/0000	125/615	409/841	$\geq r_1$	$r=0$
0/0000	95/753	221/758	$\geq r_2$	$\leq r_1$
0/0000	69/818	142/526	$\geq r_3$	$\leq r_2$
0/0000	47/856	85/321	$\geq r_4$	$\leq r_3$
0/0008	29/797	43/147	$\geq r_5$	$\leq r_4$
0/1102	15/494	13/126	$\geq r_6$	$* \leq r_5$
0/0404	3/84	4/199	$\geq r_7$	$\leq r_6$

(5). $\hat{\beta}_1$ $\hat{\beta}_2$ $\hat{\beta}_3$ $\hat{\beta}_4$ $\hat{\beta}_5$ $\hat{\beta}_6$ $\hat{\beta}_7$ $\hat{\beta}_8$ $\hat{\beta}_9$ $\hat{\beta}_{10}$ $\hat{\beta}_{11}$ $\hat{\beta}_{12}$ $\hat{\beta}_{13}$ $\hat{\beta}_{14}$ $\hat{\beta}_{15}$ $\hat{\beta}_{16}$ $\hat{\beta}_{17}$ $\hat{\beta}_{18}$ $\hat{\beta}_{19}$ $\hat{\beta}_{20}$ $\hat{\beta}_{21}$ $\hat{\beta}_{22}$ $\hat{\beta}_{23}$ $\hat{\beta}_{24}$ $\hat{\beta}_{25}$ $\hat{\beta}_{26}$ $\hat{\beta}_{27}$ $\hat{\beta}_{28}$ $\hat{\beta}_{29}$ $\hat{\beta}_{30}$ $\hat{\beta}_{31}$ $\hat{\beta}_{32}$ $\hat{\beta}_{33}$ $\hat{\beta}_{34}$ $\hat{\beta}_{35}$ $\hat{\beta}_{36}$ $\hat{\beta}_{37}$ $\hat{\beta}_{38}$ $\hat{\beta}_{39}$ $\hat{\beta}_{40}$ $\hat{\beta}_{41}$ $\hat{\beta}_{42}$ $\hat{\beta}_{43}$ $\hat{\beta}_{44}$ $\hat{\beta}_{45}$ $\hat{\beta}_{46}$ $\hat{\beta}_{47}$ $\hat{\beta}_{48}$ $\hat{\beta}_{49}$ $\hat{\beta}_{50}$ $\hat{\beta}_{51}$ $\hat{\beta}_{52}$ $\hat{\beta}_{53}$ $\hat{\beta}_{54}$ $\hat{\beta}_{55}$ $\hat{\beta}_{56}$ $\hat{\beta}_{57}$ $\hat{\beta}_{58}$ $\hat{\beta}_{59}$ $\hat{\beta}_{60}$ $\hat{\beta}_{61}$ $\hat{\beta}_{62}$ $\hat{\beta}_{63}$ $\hat{\beta}_{64}$ $\hat{\beta}_{65}$ $\hat{\beta}_{66}$ $\hat{\beta}_{67}$ $\hat{\beta}_{68}$ $\hat{\beta}_{69}$ $\hat{\beta}_{70}$ $\hat{\beta}_{71}$ $\hat{\beta}_{72}$ $\hat{\beta}_{73}$ $\hat{\beta}_{74}$ $\hat{\beta}_{75}$ $\hat{\beta}_{76}$ $\hat{\beta}_{77}$ $\hat{\beta}_{78}$ $\hat{\beta}_{79}$ $\hat{\beta}_{80}$ $\hat{\beta}_{81}$ $\hat{\beta}_{82}$ $\hat{\beta}_{83}$ $\hat{\beta}_{84}$ $\hat{\beta}_{85}$ $\hat{\beta}_{86}$ $\hat{\beta}_{87}$ $\hat{\beta}_{88}$ $\hat{\beta}_{89}$ $\hat{\beta}_{90}$ $\hat{\beta}_{91}$ $\hat{\beta}_{92}$ $\hat{\beta}_{93}$ $\hat{\beta}_{94}$ $\hat{\beta}_{95}$ $\hat{\beta}_{96}$ $\hat{\beta}_{97}$ $\hat{\beta}_{98}$ $\hat{\beta}_{99}$ $\hat{\beta}_{100}$

کشاورز

%95	ی %95		$\hat{\beta}_1$	$\hat{\beta}_2$
0/0000	46/231	188/082	$= r_1$	$r=0$
0/0000	40/077	79/232	$= r_2$	$\leq r_1$
0/0000	33/876	57/205	$= r_3$	$\leq r_2$
0/0004	27/584	42/173	$= r_4$	$\leq r_3$
0/0022	21/131	30/020	$= r_5$	$\leq r_4$
0/2923	14/264	8/927	$= r_6$	$* \leq r_5$
0/0404	3/84	4/199	$= r_7$	$\leq r_6$

اما در میان می و باعث افزایش قیمت محصولات کشاورزی می .

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به درجه : قیمت نسبت به تکانه‌ی وارد شده در کوتاه‌مدت در ابتدا بدون واکنش از آن روند کاهشی پیدا می‌کند. در میان‌مدت به تدریج روند آن مثبت می و تا بلند مدت نیز ادامه می‌ی . عبارت دیگر اعمال این سیاست تجاری در کوتاه مدت منجر به کاهش قیمت محصولات- کشاورزی می اما در میان‌مدت منجر به افزایش قیمت می و این روند تا بلند نیز ادامه خواهد یا .

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به نرخ واقعی ارز: طور کلی تکانه شده در کوتاه مدت، در ابتدا اثری بر قیمت محصولات کشاورزی نمی اما در میان اثر مثبت خود را نشان می . مدت این اثر منفی خواهد شد. به عبارت دیگر واقعی ارز در میان‌مدت منجر به افزایش قیمت و در بلندمدت منجر به کاهش قیمت محصولات کشاورزی خواهد شد.

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به حجم نقدینگی: تکانه‌ی وارد شده به قیمت محصولات کشاورزی، در ابتدا و در کوتاه مدت بی ولی در میان‌مدت تأثیرات منفی ان می . در بلندمدت واکنش قیمت محصولات کشاورزی نسبت به تکانه شده از طرف حجم نقدینگی مثبت خواهد بود که نشان دهنده این است که افزایش حجم نقدینگی و عرضه پول در بلندمدت منجر به افزایش سطح قی کشاورزی می . - تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به شاخص قیمت مصرف‌کننده: طور کلی واکنش قیمت محصولات کشاورزی به تکانه قیمت مصرف‌کننده در کوتاه-

ی اما در میان مدت اثر مثبت پیدا می‌کند.

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به نااطمینانی تورمی: طور کلی قیمت کشاورزی نسبت به تکانه‌ی وارد شده از طرف نااطمینانی تورمی در کوتاه مدت بی

نتایج نشان می‌دهد که در کوتاه‌مدت بیش از 19٪ در میان کشاورزی با حدود 40٪ این اندازه 31٪ توسط تکانه قیمت محصولات کشاورزی 17/5٪ بخش کشاورزی می‌باشد. نتایج نشان می‌دهد که در بلندمدت 30٪ قیمت محصولات کشاورزی توسط تکانه قیمت محصولات کشاورزی و 18٪ بخش کشاورزی توضیح داده می‌شود.

نتیجه‌گیری و پیشنهادها

تمامی متغیرها در حالت سطح ایستا نبوده‌اند و با یک بار تفاضل‌گیری ایستا شدند. بررسی ایستایی متغیرها، متغیر نااطمینانی تورمی با استفاده از مدل GARCH متغیر رعایت شرط لازم و کافی، با استفاده از فرآیند گارچ و روش باکس جنکینز در GARCH (1 0) برآورد گردید. پس از برآورد متغیر نااطمینانی تورمی، ایستایی متغیر در سطح بررسی و تصدیق شد. VAR برآورد گردید. نتایج به دست آمده از خود الگوی VAR تفسیر نمی‌شود که از آن برای بررسی هم‌گرایی و یا پویایی الگو استفاده می‌شود. نتایج آزمون هم‌گرایی نشان دهنده بلندمدت میان متغیرهای مدل است. متغیرهای نرخ واقعی ارز، حجم نقدینگی، شاخص قیمت مصرف‌کننده و نااطمینانی تورمی رابطه بخش کشاورزی، درجه منفی و معناداری با قیمت محصولات کشاورزی دارد. این بررسی که متغیر نااطمینانی تورمی در کنار متغیرهای دیگر تاثیر معناداری بر قیمت محصولات کشاورزی داشته است، از این رو در مطالعاتی که برای تجزیه و تحلیل رفتار قیمت محصولات کشاورزی و بررسی عوامل مؤثر بر آن صورت می‌گیرد، متغیر نااطمینانی تورمی باید به یک تاثیرگذار در کنار متغیرهای دیگر

نتایج به دست آمده آشکار ساخت که تاثیر ناشی از تصمیم کلان اقتصادی، به طور مؤثری در بخش کشاورزی بازتابیده می . بنابراین ریزی برای تعیین سیه اقتصادی مناسب و اجرای این سیه ی تواند نقش بسیار مهمی در ثبات قیه ها در این کند. پیشنهاد زیر ی این تحقیق داده می :

کشاورزی،	قیمت	منفی	
جهانی		پیوستن ایران	سیاست
کشاورزی کاهش	غذایی	پرداختی	حرکت کند،
کشاورزی	تشویق تولید	سیاست	یافت. این
.	کسری	دیه	کفایی
ویژه کشاورزی،	کلان	میان	این ی
تشویق کشاورزان	بیشترین	بیش	باید
.	کنندگان	امنیت غذایی	افزایش تولید
این		کشاورزی شرایط	تنظیم قیمت
کشاورزی	ویژه	کردن تاثیرات	مناسبی
		سیاست	که باید
.	پایداری نسبی	پولی مالی	ی
باید	کشاورز این ی	ویژه	افزایش
			پویایی
			کار

ابریشمی، ح. (1388). اقتصادسنجی کاربردی: کردهای نوین، انتشارات

، خانعلی پور، الف. و عباسی، ج. (1388).

ایران: کاربردی از خانواده ARCH نامه بازرگانی، (50):120-101.

پیرایی، خ. (1390). تاثیر تورم بر رشد اقتصادی در ایران با تاکید بر

مینانی. 11(1):41-25.

پیری، م. و همکاران. (1388). آیا سطح قیمت محصولات کشاورزی متاثر از بی‌ثباتی کلان اقتصادی است؟ هفتمین کنفرانس اقتصاد کشاورزی.

حاجیان، م. . و همکاران. (1386). تاثیر سیه پولی و مالی بر متغیرهای عمده

بخش کشاورزی ایران، فصل () 47-27.

حمیده پور، ح. و همکاران، (1389). بررسی نقش درآمدهای نفتی و سیه پولی و

مالی در بخش کشاورزی ایران، فصل اقتصاد کشاورزی، 4(4):45-29.

حیدری، ح. و همکاران. (1389). اطمینانی رشد اقتصادی بر رشد اقتصادی در ایران

() هایی بر پایه (GARCH) اقتصادی ایران، سال

(43).

سلامی، . (1388). الگوهای سری زمانی برای پیش‌بینی مصرف سیب و

پرتقال در ایران، فصل کشا 67:39-51.

صباغ کرمانی، . و شقاقی شهری، . (1384). عوامل موثر بر نرخ ارز واقعی در ایران

(یافت خودرگسیون برداری) (16):76-37.

صدیقی، اچ.آر، و لاولر، کی. . (2000). اقتصادسنجی رهیافت کاربردی، ترجمه: .

شیری 1386.

عباسی نژاد، ح، و شفیعی، الف. (1384). آیا در اقتصاد ایران پول واقع

تحقیقات اقتصادی، (68):115-154.

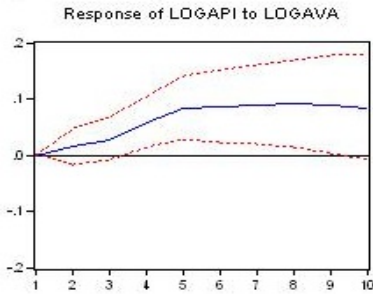
- قطمیری، م. . هراتی، ج. (1384). بررسی تاثیرات متغیرهای کلان بر شاخص قیمت مواد غذایی با استفاده از یک الگوی خودتوضیح با وقفه توزیع شده در مورد ایران (1379-1338) اقتصادی ایران، (23): 221-235.
- کرباسی، ع. و پیری، م. (1387). بررسی میان سطح قیمت محصولات کشاورزی و نااطمینانی تورمی در ایران: 1350-1383 بازرگانی، 47: 111-140.
- کرباسی، ع. و پیری، م. (1388). بررسی رابطه میان آزادی تجاری و رشد اقتصادی در ایران، مجله گجراتی، د. (1995). مبانی اقتصادسنجی، ترجمه: .، ابریشمی، انتشارات دانشگاه تهران، 1385.
- تورم و نداشتن اطمینان اسمی با استفاده از الگوی ARFIMA-GARCH . (1389). اقتصادی ایران، 10(1): 137-170.
- مقدسی، ر. و باغستانی، ع. . (1389). میان تورم و تغییرپذیری قیمت نسبی کالاهای کشاورزی در ایران، مجله تحقیقات اقتصاد کشاورزی، 2(2): 51-65.
- ی . (1387). بررسی اندازه‌ی تاثیرات ضدتورمی افزایش تولید در بخش مختلف صنعت، خدمات، و کشاورزی، فصل مدیریت، 5(11): 53-72.
- Golob, J. E. (1994). Does Inflation Uncertainty Increase with Inflation? , *Economic Review*, Federal Reserve Bank of Kansas City, 79(3):27-38.
- Hasanov, M. and Omay, T. (2010). The Relationship Inflation, Output Growth, and their Uncertainties: Evidence from Selected CEE Countries.
- Jafari Samimi, A. and Motameni, M. (2009). Inflation and Inflation Uncertainty in Iran, *Australian Journal of Basic and Applied Science*, 3(3): 2935-2938.
- Kyetsou, C. and Labys, W.C. (2006). Evidence for Chaotic Dependence between US Inflation and Commodity Prices. *Journal of Macroeconomics*, 28: 256-266.
- Labys, W.C. (2000). Can World Market Volatility Upset the US Economy? Prepared for the forty-eighth lecture in the Alex G. McKenna Economic Education Series, St. Vincent College.

❖ واکنش ناگهانی ❖

❖ واکنش ❖ کشاورز
❖ واکنش ❖ کشاورز

(1) کشاورز

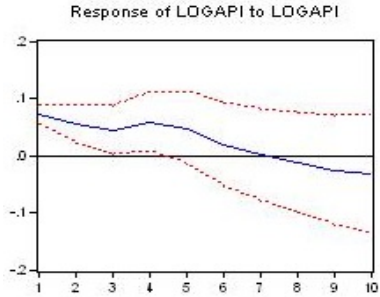
(2) کشاورز



(2)

(3)

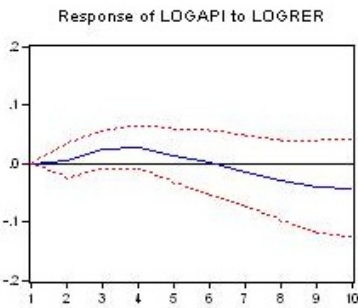
(4) ی



(1)

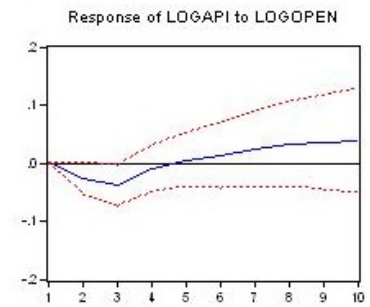
واکنش ❖ کشاورز

واکنش ❖ کشاورز



(4)

E.



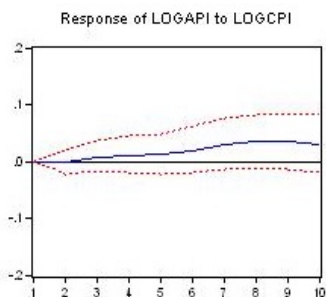
(3)

(5) ی ❖

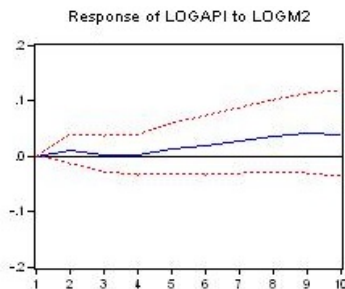
(6) کننده

❖ واکنش ❖ کشاورز

❖ واکنش ❖ کشاورز

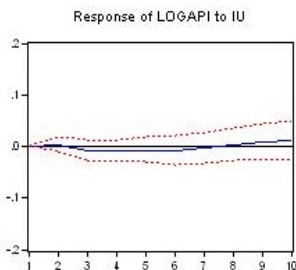


(6)



(5)

کشاورزی واکنش به



(7)

نتایج آزمون GARCH

Dependent Variable: LOGAPI

Method: ML - ARCH (Marquardt) - Normal distribution

Date: 08/16/11 Time: 02:08

Sample: 1353 1386

Included observations: 34

Convergence achieved after 47 iterations

Presample variance: backcast (parameter = 0.7)

GARCH = C(7) + C(8)*GARCH(-1)

Prob.	z-Statistic	Std. Error	Coefficient	Variable
0.1153	1.574875	1.577006	2.483588	C
0.2926	-1.052354	0.158592	-0.166895	LOGAVA
0.0000	-4.426835	0.036815	-0.162973	LOGOPEN
0.6998	0.385650	0.010958	0.004226	LOGRER
0.0320	2.144999	0.066373	0.142369	LOGM2
0.0000	11.96583	0.072328	0.865463	LOGCPI

Variance Equation

0.8692	0.164663	0.003660	0.000603	C
0.6234	0.491107	1.539917	0.756265	GARCH(-1)
3.215686	Mean dependent var	0.999263	R-squared	
1.818944	S.D. dependent var	0.999065	Adjusted R-squared	
-2.747111	Akaike info criterion	0.055626	S.E. of regression	
-2.387967	Schwarz criterion	0.080451	Sum squared resid	
-2.624632	Hannan-Quinn criter.	54.70088	Log likelihood	
1.296473	Durbin-Watson stat	5037.029	F-statistic	
		0.000000	Prob(F-statistic)	

Archive of SID