

بررسی تاثیرپذیری قیمت محصولات کشاورزی از ناظمینانی تورمی

مصطفی گودرزی، رضا رستمیان مهسا تسليمي^۱

تاریخ دریافت: 1391/5/5

تاریخ پذیرش: 1390/10/23

چکیده

ایران بی کننده‌یی افزایش ی دی که با آن می کشوارز در این پژوهش مشکل کشاورزی از این نظر با روشن خودرگرسیون برداری GARCH، مدل موردنظر با تکانه متغیرهای قیمت محصولات ناگهانی قیمت محصولات کشاورزی به تکانه آزادی تجارتی، نرخ واقعی ارز، حجم نقدینگی، ناظمینانی تورمی و کشاورزی، ارزش افزوده بخش کشاورز آزادی تجارتی، نرخ واقعی ارز، حجم نقدینگی، ناظمینانی تورمی و قیمت مصرف‌کننده، در کشاورزی از این نظر با تکانه کشاورزی که کوتاه با تکانه کشاورزی که متغیر ناظمینانی تورمی کنار متغیرهای دیگر تاثیر این مطالعاتی که تجزیه تحلیل قیمت کشاورزی می‌گیرد، متغیر ناظمینانی تورمی باید یک عامل تأثیرگذار کنار متغیرهای دیگر بررسی.

C51 C53 E31 Q11 :JEL

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

به ترتیب استادیار جوی کارشناسی ارشد، گروه اقتصاد کشاورزی، دانشگاه ازاد اسلامی
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 همک 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 کالاهای خدمات در نتیجه (کیتسو ولی به ی
2006). تورم می دلیل تولیدکننده، مصرفکننده و سرمایه‌گذار در آینده شکل
گیرد. در اقتصادهای ملت‌های نیز افزایش فعالی تجاری بازار بورس باعث تشدید رشد
ی (ای 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 درنتیجه در شرایط کاهش نیافتن تولید، منجر به ایجاد مازاد
کالا و خدمات می . ترکیب دستمزدهای پایین، افزایش بیکاری، افزایش شاخص بهای
کالاهای خدمات مصرفی چرخه‌ی رکود اقتصادی را نشان می (قدسی و باستانی،
1389).
ی زیادی را بر جامعه تحمیل می‌کند.

صاحبان دارایی و به زیان مزد- بی‌ثباتی در اقتصاد کلان کوتاه‌تر شدن افق زمانی تصمیم‌گیری و کاهش سرمایه
ی تولیدی و در نتیجه کاهش رشد اقتصادی می (پیرایی و دادر، 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 . ی که به گستردگی برای کمی
کردن وضعیت بی‌ثباتی کلان اقتصادی و تقریب آن کار می سرانجام به یافتن مقیاسی

گیری ناطمینانی تورمی و وضعیت متغیر توصیف‌کننده بی ثبات کلان اقتصادی منجر می‌شود (1994). اخیر در جایگاه شاخصی برای نشان دادن وضعیت بی ثباتی ناطمینانی تورمی در سال کلان اقتصادی به کار گرفته شده است. متغیرهای بخش شاخص قیمت محصولات کشاورزی از وضعیت بی ثباتی اقتصادی و نوسان یا ها تاثیرپذیر هستند. همین علت، این مطالعه رابطه میان شاخص قیمت محصولات کشاورزی با ناطمینانی 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 داد که برای کنترل تورم در ایران، ضروری است دولت در سیاست‌گذاری خویش توجه بیشتر 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 توسعی (ARDL) عوامل مؤثر بر قیمت محصولات کشاورزی را با تکید بر تورم و ناطمینانی تورمی بررسی کردند. نتایج به دست آمده گویای وجود رابطه جمعی میان متغیرهای مدل و آثار متغیر ناطمینانی تورمی بر سطح قیمت محصولات کشاورزی یک متغیر جدید در کنار دیگر متغیرها، معنی‌داری و باستانی (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 داد که در کوتاه مدت و معنی‌داری میان تورم و تغییرپذیری قیمت نسبی کالاهای کشاورزی مثبت و معنی‌داری میان تورم و تغییرپذیری قیمت نسبی کالاهای کشاورزی مثبت، تنها متغیر تورم تاثیر مثبت و معنی‌دار بر تغییرپذیری قیمت کالاهای کشاورزی شناسایی کردند.

¹ Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (GARCH)

² Johansen cointegration test

نرسی دا . (1389) به بررسی پویی

نداشتن اطمینان تورمی پرداختند. به طور کلی این محقق 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 گنجز ارتباط میان تورم و ناطمینانی تورمی بررسی کرد . نتایج مطالعه نشان د که تورم در ایران منجر به ناطمینانی تورمی بیش می شود، اما روابط معکوس معنادار نیست.

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

این مطالعه بررسی تاثیرپذیری سطوح قیمتی محصولات کشاورزی از ناطمینانی رمی است. به همین منظور از متغیرهای کلان اقتصادی و روش خودرگرسیون برداری شده است. برای انجام این بررسی بهره گرفته شده است. (VAR) ی شیوه بانک مرکز 1353-1386 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 وسیه ARDL GARCH .

¹ Jafari samimi and Motameni (2009).

² Hasanov and Omay (2010).

روش تحقیق

طورکلی مدل ساختاری و غیر زمانی به کار برای پیش‌بینی به شیوه رگرسیون تک یی و زمان است، در حالی که مدل غیر زمانی است، در آن مدل می‌باشد.

خطایی که پیش‌بینی‌پذیر آینده متغیرها به وسی نیست، تعیین می‌باشد. این مدل تکنیک باکس جنکینز استفاده شده است (خودرگرسیون برداری) (حمیده پور و همکاران، 1389).

(IU)	(GARCH)
یافته شده	یافته شده
یک ARIMA (p,q)	یک GARCH (p,q)
GARCH	GARCH
همکاران، 1389	

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

$$\varepsilon_t^2 = \alpha_0 + \sum_{i=1}^p \varepsilon_{t-i}^2 + \sum_{j=1}^q \varepsilon_{t-j}^2 \quad (2)$$

$$\varepsilon_t = \varepsilon_t |_{x_t} \quad (3)$$

¹ Auto Regressive Integrated Moving Average

² Auto Regressive

³ Moving Average

⁴ Vector Auto regressive

⁵ Autoregressive Conditional Heteroskedasticity (ARCH)

$$(1) \text{ که یک مدل زمانی است: } \varepsilon_t = \omega + \beta_1 \varepsilon_{t-1} + \dots + \beta_p \varepsilon_{t-p}$$

که ε_t تاخیری از ε_{t-i} است.

$$1 \quad (\omega^2_{t-i})$$

$$\dots \quad \sigma_{t-j}^2 \quad \dots \quad \dots \quad \dots$$

$$\dots \quad \sigma_{t-i}^2 \quad \dots \quad \dots \quad \dots \quad \dots$$

شاید:

$$\omega_i > 0 \quad \forall i = 1, 2, \dots, p \quad (3)$$

$$\beta_j > 0 \quad \forall j = 1, 2, \dots, q \quad (4)$$

که ω نیز باید GARCH(p,q) باشد.

$$\sum_{i=1}^p \beta_i + \sum_{j=1}^q \beta_j < 1 \quad (5)$$

تکانه این صورت کافی تامین همکاران، 1388.)

¹ ARCH

² GARCH

باکس جنکیه	آکائیک ^۱	آکائیک
روش خودرگرسیون برداری یک گزینه در کنار روش (گجراتی و ابریشمی، ۱۳۸۵).	شدید کریستوفر سیمز قرار گرفت و گزینه VAR نظر وی تئوری نمی یاری لازم را برای شناسایی مدل متغیرهای درون VAR یک سیمز (۱۹۸۰) پیشنهاد شد.	متغیرهای درون می دیگر متغیرهای زای مدل توضیح داده می . دو سری زمانی X_t Y_t برای دو متغیر به صورت زیر (نوفرستی، ۱۳۸۹):
$X_t = a_0 + \sum_{j=1}^k B_j X_{t-j} + \sum_{i=1}^n b_i Y_{t-i} + u_{1t}$		(6)
$Y_t = a_0 + \sum_{j=1}^k A_j X_{t-j} + \sum_{i=1}^n \lambda_i Y_{t-i} + u_{2t}$		(7)
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 باشتگی را تشدید می کند، پس باید در مدل نایستا است وجود بردار یا بردارهای VAR که شامل سر (VAR) می باشد.	OLS برآورده می باشد و VAR	
		1.

¹ Akaike Information Criterion (AIC)

VAR مانند پیش

می باشد که اینجا می بینیم که در سال 1386 (1386) نوشته می باشد.

VAR می نوشه می باشد که متغیر به صورت رابطه (8)

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

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

برای ساده کردن عرض از مبدأ حذف می کرد. فرض بر این است که متغیرهای آن مرتبه گرایی 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:

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

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

متغیرهای گرایی میان شیوه یک تصحیح کرد. ایستاده میان گرایی 1 ایستاده میان نتیجه ایستاده میان متغیرها.

این پژوهش و با بررسی مطالعات داخلی و خارجی انجام

شده در این خصوص به صورت زیر :

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

که در آن API کشاورزی است.

AVA کشاورزی است. OPEN کشاورزی است. 1376 کشاورزی است.

یکی است.

$$\text{کل} \quad \frac{\text{GDP}}{\text{IM}} \quad \text{EX} \quad \text{ی} \quad \cdot \quad : (1387 \quad \text{کرباسی})$$

$$\text{OPEN} = \frac{\text{IM} + \text{EX}}{\text{GDP}} \quad (14)$$

این $^1(\text{P.P.P})$ کشور (RER) : (1387 کرباسی)

$$\text{RER} = \text{ER} \times \frac{\text{WPI}}{\text{CPI}} \quad (15)$$

کشور . یک . که . WPI .
 CPI . یک . یک .
 RER . ER . کننده .
 IU . 1376 . کننده . CPI .
 که . یک .
 برای این . کشاورز (API) .
 . یافته (GARCH) . یافته .
 یکی . یافته . یافته .
 :

$$\hat{\epsilon}_t^2 = \alpha_0 + \alpha_1 \hat{\epsilon}_{t-1}^2 + \alpha_2 \hat{\epsilon}_{t-2}^2 + \dots + \alpha_p \hat{\epsilon}_{t-p}^2 + \beta_1 M_{t-1} + \beta_2 M_{t-2} + \dots + \beta_q M_{t-q} + \nu_t \quad (1)$$

¹ Purchasing Power Parity (P.P.P)

² Stationarity

کشاورز

یکی یی یه .(1)

ی	ی	ی	ی	ی	ی	ی	ی
-3/64*	-3/59**	-3/61	-3/46	-2/59	-0/87	-3/46	Log api
-2/95**	-4/93*	-2/61	-2/64	-2/95	-0/75	-2/64	Log AVA
-2/16***	-3/33**	-2/61	-3/64	-2/95	-2/40	-3/64	Log OPEN
-2/95	-2/84***	-2/61	-3/64	-2/95	1/07	-2/64	Log m2
-2/61	-4/05*	-2/61	-3/64	-2/95	-2/18	-3/64	Log RER
-2/61	-3/39**	-2/61	-3/64	-2/95	-0/26	-3/64	Log CPI

. 10% 5% 1% ی ی ی ی ی ی ی ی

که دی ی این که
 ی مک کی گوچک
 کشاورز ی ی ی ی ی ی ی ی
 ی ی ی ی ی ی ی ی یکی
 ی ی ی ی ی ی ی ی ی ی ی ی ی ی ی
 کشاورز : (16)

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

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

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

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

که یک بیشترین (SBC) (AIC) کائیک (HQ) کوئی (2005) کیم 120 کم بیسی (1388) .(3)

کشاورز VAR (3)

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

این جا می بھینه (1 3) می یوهانسون 2 بیشترین 3 که می بیشترین می که می (4)

¹ Likelihood ratio

² Trace

³ Maximum Eigen value

۴. (4) $\leq r_1 \leq r_2 \leq r_3 \leq r_4 \leq r_5 \leq r_6 \leq r_7$

کشاورز

%95	\leq %95		\leq	\leq
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	$\geq r_7$	$\leq r_6$

۵. (5) $= r_1 = r_2 = r_3 = r_4 = r_5 = r_6 = r_7$

کشاورز

%95	$=$ %95		$=$	$=$
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	$= r_7$	$\leq r_6$

که	ی	بیشترین	ب دی می	ی	ی	که	ی
ی	ی	ی	ی	ی	ی	ی	ی
که	ی	نکته	ی	ی	ی	کرده	5
ی	ی	ی	ی	ی	ی	ی	5
وار	ی	ی	ی	ی	ی	VAR	ی
واکنش ناگهانی ^۱	ی	ی	ی	ی	ی	تک	ی
کرمانی	ی	ی	ی	ی	ی	۲	ی
VAR	کشاورز	ی	ی	ی	ی	(1384)	ی
						.	6

VAR کشاورز .(6)

انحراف معیار	ضریب	نام متغیر
0/0049	-0/057	Log AVA
0/00131	-0/266	Log OPEN
0/0007	0/0290	Log RER
0/0012	0/230	Log M2
0/002	0/726	Log CPI
0/0097	0/668	IU

عکس ناگهانی و واکنش یک تکانه که تکانه میان ی کند .

¹ Impulse response functions² Variance Decomposition

یک یا یک
و اکنـش

کشاورز ناگهانی عکس .(7)

IU	Log CPI	Log M2	Log RER	Log OPEN	Log AVA	Log API	
0/0000	0/0000	0/0000	0/0000	0/0000	0/0000	0/0716	1
0/0022	-0/0028	0/0087	0/0074	-0/0257	0/0141	0/0549	2
-0/0077	0/0072	-0/0071	0/0220	-0/0387	0/0280	0/0438	3
-0/0088	0/0107	-0/0102	0/0249	-0/0099	0/0580	0/0588	4
-0/0078	0/0118	0/0067	0/0158	0/0049	0/0828	0/0469	5
-0/0077	0/0193	0/0170	0/0080	0/0122	0/0856	0/0186	6
-0/0040	0/0293	0/0294	-0/0021	0/0238	0/0885	0/0006	7
0/0031	0/0343	0/0441	-0/0125	0/0329	0/0901	-0/0135	8
0/0087	0/0343	0/0532	-0/0200	0/0353	0/0882	-0/0265	9
0/0123	0/0305	0/0542	-0/0234	0/0379	0/0840	-0/0327	10

:

نتایج بررسی توابع عکس العمل ناگهانی متغیرهای شاخص قیمت محصولات کشاورزی به شرح زیر است. (نمودارهای مربوط در بخش پیوست آورده شده است).

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به قیمت محصولات کشاورزی: تکانه وارد شده از طرف قیمت محصولات کشاورزی در دوره اول باعث افزایش قیمت محصولات کشاورزی به اندازه 0/07 واحد می باشد. این اثر در دوره بعدی باعث افزایش 0/05 قیمت می باشد. این روند کاهشی ادامه می یابد. یک تکانه ناگهانی به شاخص قیمت محصولات کشاورزی در بلندمدت منجر به کاهش قیمت محصولات کشاورزی به اندازه 0/03 می باشد.

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به ارزش افزوده بخش کشاورزی: تکانه بخش کشاورزی به قیمت محصولات کشاورزی در کوتاه مدت در ابتدا بی

اما در میان می و باعث افزایش قیمت محصولات کشاورزی

می .

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به درجه :

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: طورکلی 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 تاثیرات 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: طورکلی

واکنش قیمت محصولات کشاورزی به تکانه قیمت مصرف‌کننده در کوتاه-

اما در میان مدت اثر مثبت پیدا می‌کند.

- تابع واکنش قیمت محصولات کشاورزی به ناطمنانی تورمی: طورکلی قیمت

کشاورزی نسبت به تکانه‌ی وارد شده از طرف ناطمنانی تورمی در کوتاه مدت بی

واکنش است اما در میان از آن تاثیرات منفی را به قیمت

کشاورزی وارد می‌کند. این تکانه در بلند

دیگر تکانه یعنای تورمی منجر به افزایش قیمت محصولات کشاورزی در بلند

می.

این نیز بازتاب ناگهانی تحلیل پویایی کوتاه کاربرد . این متغیرهای تقسیم می‌شوند .

این ترتیب دیگر متغیرهای تغییرات متغیرهای دیگری گیری .

8

(8). تجزیه شاخص قیمت محصولات کشاورزی

IU	cpi Log	Logm2	Log rer	Log open	Log ava	Log api	
10/25	11/27	3/15	1/41	18/94	15/83	39/12	1
8/38	14/18	4/57	1/28	18/71	13/78	39/06	2
8/96	11/37	10/41	6/06	14/93	16/96	31/27	3
8/48	10/82	9/86	5/74	14/33	16/29	34/44	4
7/87	10/20	9/90	5/57	16/96	17/52	31/95	5
7/57	9/97	9/50	5/70	18/80	17/67	30/75	6
7/20	9/55	9/29	6/38	17/87	17/46	32/23	7
6/99	9/63	9/23	6/83	17/36	18/03	31/89	8
7/11	9/54	9/50	7/38	17/10	17/96	31/36	9
7/20	9/53	9/52	7/44	17/03	18/03	31/21	10

:

نتایج نشان می‌دهد که در کوتاه‌مدت بیش یا کشاورزی با حدود ۴۰٪ در میان %19 این اندازه %31 توسط تکانه قیمت محصولات کشاورزی %17/5 بخش کشاورزی می‌باشد. نتایج نشان می‌دهد که در بلند %30 قیمت محصولات کشاورزی توسط تکانه قیمت محصولات کشاورزی و %18 بخش کشاورزی توضیح داده می‌باشد.

نتیجه‌گیری و پیشنهادها

تمامی متغیرها در حالت سطح ایستا نبوده اند و با یک بار تفاضل‌گیری ایستا شدند. بررسی ایستایی متغیرها، متغیر ناظمینانی تورمی با استفاده از مدل GARCH . متغیر رعایت شرط لازم و کافی، با استفاده از فرآیند گارچ و روش باکس جنکینز در (1 0) GARCH برآورد گردید. پس از برآورد متغیر ناظمینانی تورمی، ایستایی متغیر در سطح بررسی و تصدیق شد. نتایج به دست آمده از خود الگوی VAR تفسیر نمی‌کنند که از آن برای بررسی همگرایی و یا پویایی الگو استفاده می‌باشد. نتایج آزمون همگرایی نشان دهنده بلندمدت میان متغیرهای مدل است. متغیرهای نرخ واقعی ارز، حجم نقدینگی، شاخص قیمت مصرف کننده و ناظمینانی تورمی رابطه بخش کشاورزی، درجه منفی و معناداری با قیمت محصولات کشاورزی دارد. این بررسی که متغیر ناظمینانی 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 ناظمینانی تورمی باید به یک تاثیرگذار در کنار متغیرهای دیگر باشد.

نتایج به دست آمده آشکار ساخت که تاثیر ناشی از تصمیم کلان اقتصادی، به طور مؤثری در بخش کشاورزی بازتابیده می‌باشد. بنابراین ریزی برای تعیین سیاست اقتصادی مناسب و اجرای این سیاست تواند نقش بسیار مهمی در ثبات قیمت‌ها در این کندهای پیشنهاد زیر دارد. این تحقیق داده می‌باشد:

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

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

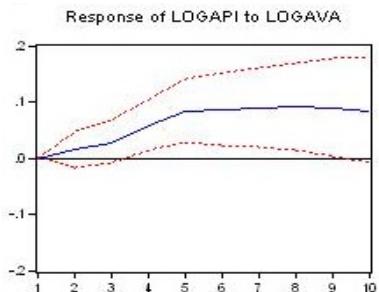
- ، خانعلی پور، الف. و عباسی، ج. (1388). ایران: کاربردی از خانواده ARCH
- نامه بازرگانی، (50): 120-101.
- پیرایی، خ. (1390). تاثیر تورم بر رشد اقتصادی در ایران با تکید بر مینانی. . 25-41(1)11
- پیری، م. و همکاران. (1388). آیا سطح قیمت محصولات کشاورزی متاثر از بی ثباتی کلان اقتصادی است؟ هفتمین کنفرانس اقتصاد کشاورزی.
- حجیان، م. . و همکاران. (1386). تاثیر سیاست مالی بر متغیرهای عمدۀ پولی و مالی در بخش کشاورزی ایران، فصل 27-47 ()
- حمیده پور، ح. و همکاران، (1389). بررسی نقش درآمدهای نفتی و سیاست مالی در بخش کشاورزی ایران، فصل 29-45 (4): 4.
- حیدری، ح. و همکاران. (1389). اطمینانی رشد اقتصادی بر رشد اقتصادی در ایران اقتصادی ایران، سال (GARCH) هایی بر پایه (43).
- سلامی، . (1388). الگوهای سری زمانی برای پیش‌بینی مصرف سیب و پرتقال در ایران، فصل 51-39: 67
- صباغ کرمانی، . و شفاقی شهری، . (1384). عوامل موثر بر نرخ ارز واقعی در ایران یافت خودرگرسیون برداری (16): 37-76
- صدیقی، اج. آر، و لاولر، کی.. (2000). اقتصادسنجی رهیافت کاربردی، ترجمه: .
- 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 موادغذایی 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 ناطمینانی 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 نداشت ناطمینان اسمی با استفاده از الگوی ARFIMA-GARCH (1389). ی. بی. ی. بی. مقدسی، ر. و با Gustani، ع. (1389). میان تورم و تغییرپذیری قیمت نسبی کالاهای کشاورزی در ایران، مجله حقیقات اقتصاد کشاورزی، 2(2): 51-65.
- ی. ب. ی. ب. (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.

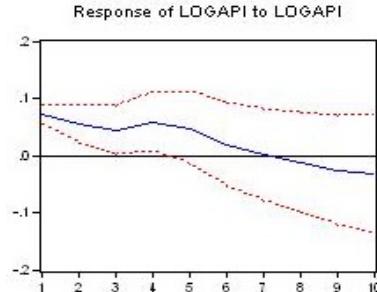
واکنش ناگهانی $\dot{\phi}$

(1) کشاورز $\dot{\phi}$
 (2) کشاورز $\dot{\phi}$

کشاورز $\dot{\phi}$
 کشاورز $\dot{\phi}$



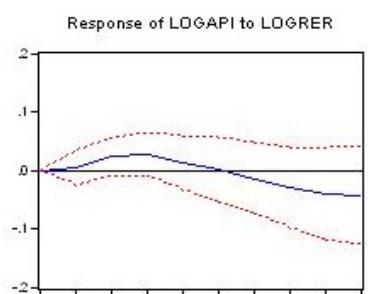
(2)



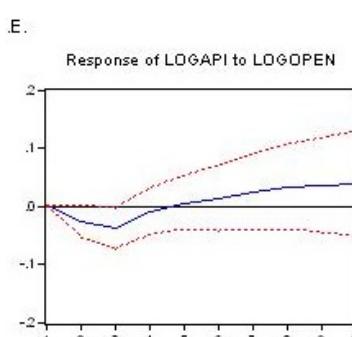
(1)

(3) کشاورز
 (4) کشاورز $\dot{\phi}$

کشاورز $\dot{\phi}$
 کشاورز $\dot{\phi}$



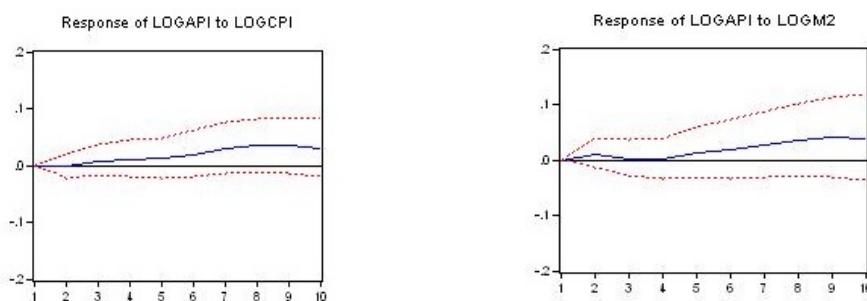
(4)



(3)

(5) کشاورز $\dot{\phi}$
 (6) کشاورز $\dot{\phi}$

کشاورز $\dot{\phi}$
 کشاورز $\dot{\phi}$

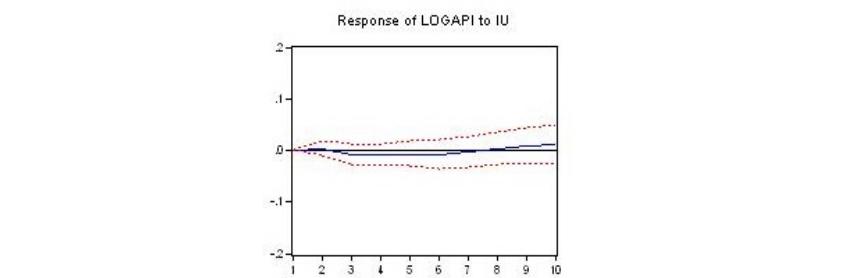


(5)

کشاورزی

(5)

و اکنون

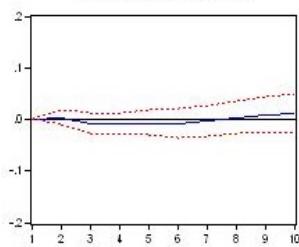


(6)

سی

کشاورز

Response of LOGAPI to IU



(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

				C
				GARCH(-1)
0.8692	0.164663	0.003660	0.000603	
0.6234	0.491107	1.539917	0.756265	
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)