

## عنوان مقاله:

پیش بینی قیمت و ارزش در معرض ریسک پسته ایران در بازار جهانی با استفاده از معادلات دیفرانسیل تصادفی

## محل انتشار:

تحقیقات اقتصاد و توسعه کشاورزی ایران، دوره 53، شماره 4 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 13

## نویسندگان:

سمیه السادات موسوی - استادیار، گروه مهندسی صنایع، دانشکده فنی مهندسی، دانشگاه میبد، میبد، ایران

عباسعلی جعفری ندوشن - استادیار، گروه مهندسی صنایع، دانشکده فنی مهندسی، دانشگاه میبد، میبد، ایران

محمد حمیدپور بدوئی - دانشجوی کارشناسی ارشد سیستم های مالی، گروه مهندسی صنایع، دانشکده فنی مهندسی، دانشگاه میبد، میبد، ایران

## خلاصه مقاله:

رقابت روزافزون آمریکا با ایران در بازار جهانی پسته، سبب شده است سهم این کشور در صادرات جهانی افزایش یابد و جایگزین سهم ایران شود. از طرفی در ساختار بازار انحصار چند جانبه، تغییرات قیمت جهانی محصول، وابستگی قوی نسبت به رقیبی دارد که سهم عمده‌ای از بازار جهانی را در دست دارد. برای پیش‌بینی ریسک و قیمت محصول با استفاده از معادلات دیفرانسیل تصادفی، نیاز به تخمین پارامترهای آماری قیمت است. با توجه به پیش‌بینی روند بازار و تغییر رفتار بازار جهانی پسته در سال‌های اخیر، سوابق اطلاعاتی مناسب و کافی در وضعیت جدید بازار وجود ندارد. در این مطالعه، برای پیش‌بینی قیمت پسته ایران در بازار جهانی، از الگوی حرکت براونی هندسی با پارامترهای تخمینی از سری قیمتی محصول مشابه در وضعیت مشابه بازار جهانی استفاده شده است. بررسی‌های انجام‌شده در بازه ۲۰۱۸-۱۹۹۲ نشان داد که پارامترهای آماری قیمت صادراتی بادام می‌تواند چارچوبی برای پیش‌بینی قیمت صادراتی پسته و ریسک قیمت آن در رویکرد شبه‌انحصاری بازار فراهم کند. بر اساس نتایج پژوهش حاضر، عملکرد الگوی براونی هندسی در پیش‌بینی قیمت جهانی پسته با احتساب رفتار بازار، از نظر شاخص تایل به متوسط ۵/۰ بهبود می‌یابد. همچنین، بر مبنای سنجش‌های ریسک از جمله ارزش در معرض ریسک و شاخص بی‌ثباتی کوپاک، نوسان قیمت پسته در بازه ۲۰۲۳-۲۰۱۹ کاهش خواهد یافت و در سطح اطمینان ۹۹.۹٪ حداقل قیمت هر تن پسته در سال ۲۰۲۳، ۴۴۶۱ دلار خواهد بود.

## کلمات کلیدی:

پیش بینی قیمت، پسته ایران، معادلات دیفرانسیل تصادفی، الگوی حرکت براونی هندسی، ارزش در معرض ریسک

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1658093>

