

عنوان مقاله:

ریسک سیستماتیک صادرات بخش های مختلف اقتصادی در ایران

محل انتشار:

دوازدهمین کنفرانس تخصصی ملی اقتصاد کشاورزی (سال: 1400)

تعداد صفحات اصل مقاله: 14

نویسندگان:

سیدامیررضا سیادتی فینی - دانشجوی کارشناسی

عدالت سلیم اودلو - دکتری اقتصاد کشاورزی، دانشگاه تهران

خلاصه مقاله:

سیاست گسترش تجارت بین الملل و توسعه صادرات از دیرباز مورد توجه اقتصاددانان و سیاستگذاران اکثر کشورهای جهان بوده و یکی از ارکان مهم برنامه ریزیها به خود اختصاص داده است. اما تجارت محصولات بخش های مختلف اقتصادی همانند هر فعالیت اقتصادی دیگر شامل ریسک های مختلف و از جمله ریسک سیستماتیک میباشد و صادرکنندگان محصولات مختلف انتظار دارند در برابر تحمل ریسک صادرات، بازدهی متناسب با آن ریسک به دست آورند. از این رو هدف مطالعه حاضر اندازه گیری ریسک سیستماتیک صادرات کشور به تفکیک بخش های اقتصادی و سنجش وضعیت جبران ریسک صادرات این بخش ها در بازه زمانی سال های ۲۰۱۸ - ۲۰۰۱ میباشد. این مطالعه جهت نیل به هدف خود از الگوی قیمت گذاری دارایی سرمایه که یک روش جهت به دست آوردن قیمت سرمایه گذاری متناسب با ریسک متحمله میباشد استفاده کرده است. نتایج مطالعه نشان میدهد، بخش نفت، گاز و پتروشیمی با ضریب ریسک سیستماتیک ۱۵ / ابر ریسک ترین بخش از نظر صادرات میباشد. همچنین صادرات بخش کشاورزی و صنعت و معدن توانسته اند بازدهی متناسب با توجه به ریسک سیستماتیک خود به دست آورند اما بازدهی حاصل از بخش نفت، گاز و پتروشیمی کمتر از بازدهی انتظاری این بخش بوده و نتوانسته است ریسک خود را جبران نماید. با توجه به نتایج به دست آمده پیشنهاد میگردد که بخش کشاورزی و صنعت و معدن با تمهیدات لازم همانند بسته بندی مناسب، اجتناب از فروش فلهای و ... روند مثبت خود را تداوم بخشند. در بخش نفت و پتروشیمی لازم است سیاستگذاران کشور ورود کرده و با مذاکرات بینالمللی و کاهش فضای بد سیاسی میزان فروش محصولات این بخش را افزایش دهند.

کلمات کلیدی:

صادرات، CAPM، ریسک سیستماتیک، کشاورزی، نفت

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1798382>

