

عنوان مقاله:

بررسی نوسانات قیمت ذرت و چرخه ی قیمتی آن با به کارگیری الگوی GARCH و هارمونیک

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد کشاورزی، دوره 6، شماره 2 (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

ناصر شاهنوشی - دانشیار دانشگاه فردوسی مشهد

بهزاد فکاری سردهایی - دانشجوی کارشناسی ارشد رشته اقتصاد کشاورزی دانشگاه فردوسی مشهد.

مصطفی کجوری گشنیانی - دانشجوی کارشناسی ارشد رشته اقتصاد کشاورزی دانشگاه فردوسی مشهد.

خلاصه مقاله:

ذرت، پس از گندم و برنج، سومین محصول مهم و راهبردی کشاورزی در جهان است. این محصول، افزون بر خوراک طیور، دانه یی سودمند برای تولید روغن خوراکی، نشاسته، گلوکز، ماده ی اولیه در تولیدات صنعتی و اتانول و برخی فرآورده های دیگر است. افزایش اندک و نوسان کم قیمت کالاها و خدمات، رشد اقتصادی با ثبات و پایدار، ارتقای سطح رفاه اجتماعی و تسریع فرآیند توسعه اقتصادی را در پی خواهد داشت. در این مطالعه، چرخه های قیمتی با به کارگیری روش هارمونیک و نوسانات موجود در سری زمانی قیمت ذرت با الگوی GARCH بررسی شده است. اطلاعات روزانه ی قیمت ذرت از تاریخ 22/7/1386 تا 19/7/1390 از بورس کالای کشاورزی ایران به کارگرفته شده است. نتایج تحلیل هارمونیک نشاندهنده ی چرخه ی بلندمدت 21 ماهه در قیمت ذرت در دوره ی مورد بررسی است. نتایج مدل GARCH نشان داد که جز عوامل اخلاص که سهم کمی در ایجاد واریانس شرطی در قیمت ذرت دارند، نوسانات قیمت باعث تشدید نوسانات قیمت ذرت در آینده میشود. با توجه به این که قیمت تضمینی با وجود هزینه هایی که برای دولت داشته است، نتوانسته از نوسانات قیمت جلوگیری کند، سیاست گذاران در این زمینه باید شرایطی را ایجاد کنند تا خریداران و فروشندگان محصول ذرت تشویق به خرید و فروش در بورس و استفاده از قراردادهای آینده و اختیار معامله شوند.

کلمات کلیدی:

ذرت، بورس کالای کشاورزی ایران، نوسانات قیمت، الگوی هارمونیک، مدل GARCH

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/763181>

