

عنوان مقاله:

به کارگیری رهیافت کاپیولا برای مدل سازی وابستگی قیمت نفت و نرخ ارز با قیمت نهاده های وارداتی صنعت دام ایران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد کشاورزی، دوره 12، شماره 2 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 19

نویسندگان:

اسماعیل پیش بهار - دانشیار گروه اقتصاد کشاورزی دانشگاه تبریز

پریسا پاکروح - دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد کشاورزی

محمد قهرمانزاده - دانشیار اقتصاد کشاورزی

خلاصه مقاله:

چکیده بخش کشاورزی ایران دارای ارتباط های دو سویه ای با بازارهای جهانی است زیرا از یک سو صادرکننده محصولات عمده و از یک سو واردکننده نهاده ها برای صنعت دام است، لذا به واسطه حجم چنین مبادله هایی تحت تاثیر قیمت ها و دگرگونی های جهانی قرار خواهد گرفت. در بسیاری از کشورهای جهان بعد از آغاز نوسان های قیمت نفت از سال 1382 و در ادامه آغاز بحران مالی جهانی از سال 1384، شدت و نوع رابطه بین قیمت نفت و نرخ ارز تغییر یافته است و بسیاری از قیمت های جهانی به ویژه بخش کشاورزی را بیشتر از گذشته تحت تاثیر قرار داده است که به نظر می رسد در ایران هم صنعت دام به واسطه ای وارداتی بودن اغلب نهاده ها تحت تاثیر قرار گرفته است. بنابراین در این بررسی به ارزیابی همبستگی قیمت نفت و نرخ ارز با قیمت نهاده های صنعت دام در دو بازه زمانی 83-1374 (پیش از بحران) و 93-1384 (پس از بحران) با استفاده از رهیافت واین کاپیولا بر اساس ARMA-MGARCH پرداختیم. نتایج به دست آمده از این بررسی نشان داده، نهاده های ذرت، سویا و جو در دوره پس از بحران نسبت به دوره پیش از بحران همبستگی مثبت و بالایی با قیمت نفت و همبستگی منفی با نرخ ارز از خود نشان داده اند، به عنوان نمونه همبستگی بین قیمت نفت با ذرت از 05/0 به میزان 20/0 افزایش یافته است که این به دلیل تغییر شدت و نوع همبستگی بین قیمت نفت با نرخ ارز از دوره پیش از بحران به دوره پس از بحران بوده است. بنابراین به نظر می رسد نهاده های وارداتی صنعت دام با آغاز شوک های اندک قیمت نفت از سال 1382 به واسطه ی پیامدهای آغاز جنگ عراق و آمریکا و در ادامه بحران مالی جهانی از سال 1384 و افزایش جهانی قیمت نهاده های کشاورزی، بیشتر تحت تاثیر دگرگونی های جهانی قرار گرفته است. طبقه بندی JEL: C59, F31, F42

کلمات کلیدی:

صنعت دام، قیمت نفت، کاپیولا، نرخ ارز، نهاده

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/871220>

