

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ



آینده‌پژوهی توسعه صادرات زعفران با بررسی آثار بی‌ثباتی نرخ ارز

مجری طرح : سید محمد رضا حاج سید جوادی
همکار طرح : منوچهر شاهمرادی
ناظر طرح : دکتر ماندانا طوسی

بخش اول - اهداف و بررسی ادبیات موضوع اجرای طرح مدل تقاضای صادراتی زعفران

❖ مقدمه

❖ اهداف

❖ ادبیات موضوع

❖ روش تحقیق و مبانی نظری

بخش دوم : فرآیند اجرای مدل های خطی و غیر خطی اقتصاد سنجی پانلی



❖ انجام آزمون های هاسمن ، ریشه واحد پانلی و هم جمعی کانو
زعفران

❖ انجام مدل پانل خطی میانگین گروهی تلفیقی (PMG)

❖ روش پانل غیرخطی رگرسیون انتقال ملایم (PSTR)

❖ نتیجه گیری و پیشنهادات

مقدمه

- زعفران به عنوان یکی از گران‌ترین محصولات کشاورزی و دارویی جهان جایگاه ویژه‌ای در بین محصولات کشاورزی و صادراتی ایران دارد. در حال حاضر ایران بزرگ‌ترین تولیدکننده زعفران در جهان است.
- طی سالیان اخیر به عنوان یکی از اولویت‌های مهم در صادرات غیرنفتی مطرح بوده، لذا بی‌شک تغییرات نرخ ارز می‌تواند تاثیر مهمی را بر تغییر رفتارهای صادرکنندگان ایران بواسطه مدیریت ریسک در تجارت بازارهای بین‌المللی و هدف بدنبال داشته باشد.
- با درک مسئله مهم شرایط حال جامعه (تحریم و مشکلات حفظ بازار صادراتی علیرغم سیاست تاکیدی دولت به توسعه صادرات غیرنفتی) نیز به عنوان یک مولفه مهم می‌تواند زمینه ایجاد احتمال شوک‌های بی‌ثبات‌کننده از جمله جهش نرخ ارز (بواسطه تنزیل واحد پول داخلی است) را برای صادرکنندگان زعفران به همراه داشته باشد.

جغرافیایی محصول (آمار توزیع سطح زیر کشت استانی):

سال ۱۳۹۷	سال ۱۳۹۶	سال ۱۳۹۵	سال ۱۳۹۴	سال ۱۳۹۳	شرح
۱۱۱۰۳۱	۱۰۸۰۸۶	۱۰۵۲۶۹/۸	۹۲۸۸۲	۸۶۴۴۱/۱	کل سطح زیر کشت زعفران کشور
۸۷۰۰۰	۸۴۲۲۶	۸۲۷۱۲	۷۵۱۵۸	۶۹۴۰۶/۵	سطح زیر کشت خراسان رضوی
۱۵۸۰۰	۱۵۷۸۲	۱۵۷۵۴	۱۳۷۷۲	۱۴۰۹۱/۵	سطح زیر کشت خراسان جنوبی
۸۲۳۱	۸۰۷۸	۶۸۰۳/۵	۳۹۲۵	۳۱۴۳/۱	سایر استان‌ها

واحد: هکتار

وزارت جهاد کشاورزی

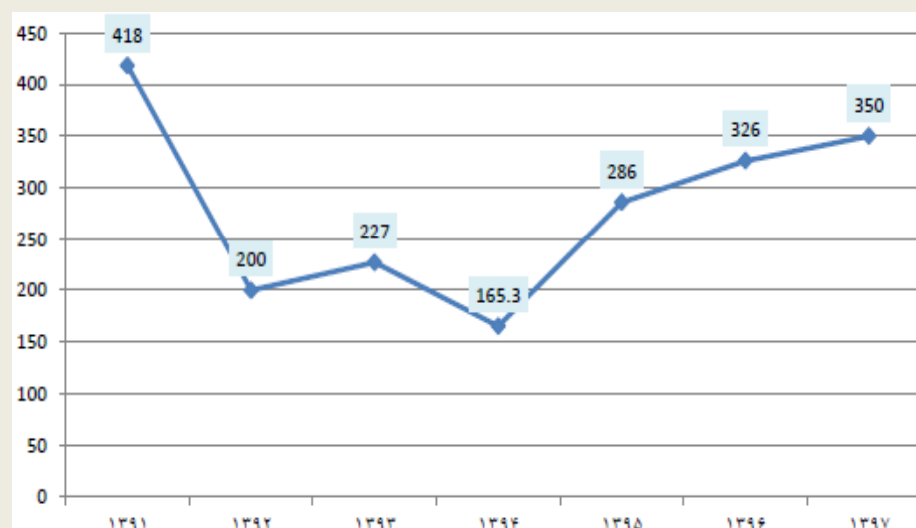
موسسه پژوهش‌های برنامه‌ریزی، اقتصاد کشاورزی و توسعه روستایی



ارزش و روند رشد صادرات ارزش: میلیون دلار

ردیف	سال	ارزش (میلیون دلار)	رشد (درصد)
۱	۱۳۹۱	۴۱۸	-۱۴
۲	۱۳۹۲	۲۰۰	-۵۲
۳	۱۳۹۳	۲۲۷	۶۰
۴	۱۳۹۴	۱۶۵,۳	-۲۷
۵	۱۳۹۵	۲۸۶	۷۴
۶	۱۳۹۶	۳۲۶	۱۱
۷	۱۳۹۷	۳۵۰	۸
۸	شش ماهه ۱۳۹۸	۹۲	-۰,۲۵

روند ارزشی صادرات زعفران کشور طی سالهای ۱۳۹۰ - ۱۳۹۷



ماخذ: سازمان توسعه و تجارت

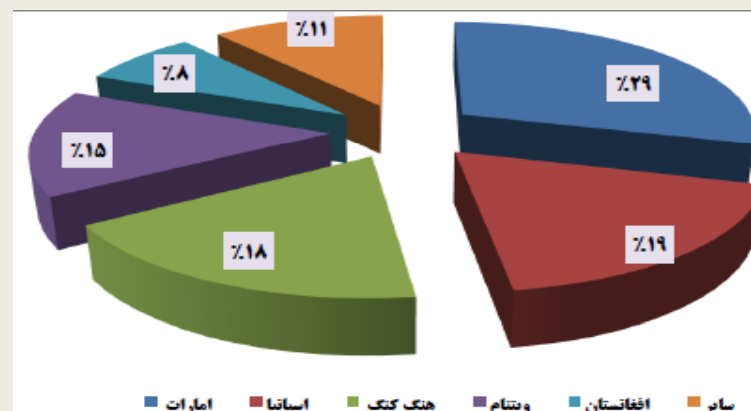
وزارت جهاد کشاورزی

موسسه پژوهش‌های برنامه‌ریزی، اقتصاد کشاورزی و توسعه روستایی

کشورهای عمده وارد کننده از ایران

رتبه	کشورهای عمده	سال ۱۳۹۷		کشورهای عمده	سال ۱۳۹۶	
		ارزش	سهم از کل (%)		ارزش	سهم از کل (%)
۱	امارات	۱۰۲,۵	۲۹	امارات	۸۹,۶	۲۷
۲	اسپانیا	۶۴,۸	۱۹	اسپانیا	۶۶	۲۰
۳	هنگ کنگ	۶۴	۱۸	هنگ کنگ	۹۶,۵	۳۰
۴	ویتنام	۵۳	۱۵	افغانستان	۵	۲
۵	افغانستان	۲۶,۷	۸	چین	۲۲,۷	۷
۶	سایر	۳۹	۱۱	سایر	۴۶,۲	۱۴
	جمع کل	۳۵۰	۱۰۰	جمع کل	۳۲۶	۱۰۰

نمودار بازارهای اصلی محصول زعفران در سال ۹۷ میلیون دلار



ماخذ: سازمان توسعه و تجارت

وزارت جهاد کشاورزی

موسسه پژوهش‌های برنامه‌ریزی، اقتصاد کشاورزی و توسعه روستایی



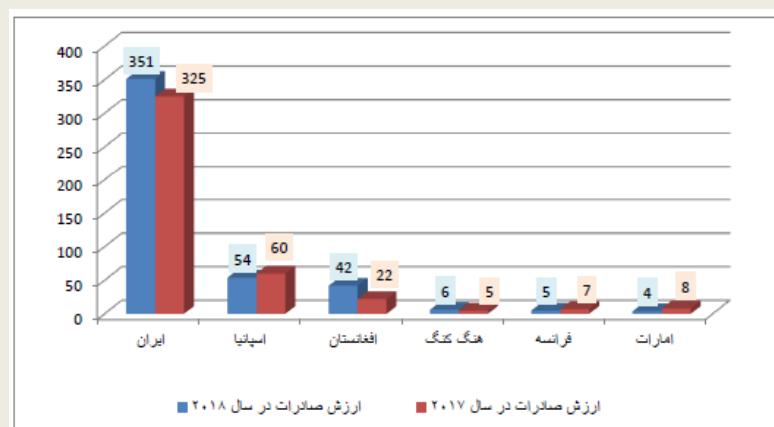
تولید جهانی زعفران :

ارزش: میلیون دلار

کشورهای عمده صادرکننده

رتبه	کشورهای عمده	سال ۲۰۱۸		سال ۲۰۱۷	
		ارزش	سهم از کل (%)	ارزش	سهم از کل (%)
۱	ایران	۳۵۱	۷۱	۳۲۵	۷۱
۲	اسپانیا	۵۴	۲۱	۶۰	۱۳
۳	افغانستان	۴۲	۸	۲۲	۵
۴	هنگ کنگ	۶	۲	۵	۲
۵	فرانسه	۵	۲	۷	۲
۶	امارات	۴	۲	۸	۲

نمودار ارزش صادرات کشورهای عمده صادرکننده زعفران در سال ۲۰۱۸ - ۲۰۱۷



Trade map: مأخذ:

اهداف اجرای طرح

۱ بررسی ساختاری و ادبیات موضوع پژوهش‌های انجام شده در خصوص مدل‌های تقاضای صادرات زعفران با تاکید بر تغییرات شدید نرخ ارز و سایر مولفه‌های موثر

۲ محاسبه آنالیز حساسیت خطی مولفه‌های مورد نظراز طریق مدل پانل خطی PMG

۳ محاسبه آنالیز حساسیت خطی مولفه‌های مورد نظراز طریق مدل پانل خطی PSTR

۴ پیشنهادات با تاکید به ارتباط موثرتر با بورس کالای زعفران ایران در روند صادرات

• ادبیات موضوع



www.elsevier.com/locate/worlddev

World Development Vol. xx, pp. xxx-xxx, 2016
0305-750X/© 2016 Elsevier Ltd. All rights reserved.

<http://dx.doi.org/10.1016/j.worlddev.2016.10.018>

Spice Price Spikes: Simulating Impacts of Saffron Price Volatility in a Gendered Local Economy-Wide Model

MATEUSZ FILIPSKI^a, ABDELLAH ABOUDRARE^b, TRAVIS J. LYBBERT^c and J. EDWARD TAYLOR^{c,*}

^a International Food Policy Research Institute, USA

^b Ecole Nationale d'Agriculture de Meknès, Morocco

^c University of California at Davis, USA

Information seeking behaviour of ordinary and elite saffron farmers in Iran

Iraj Radad

*Department of Knowledge and Information Science,
Imam Reza International University, Mashhad, Islamic Republic of Iran*

Hassan Behzadi

*Department of Knowledge and Information Science,
Ferdowsi University of Mashhad, Mashhad, Islamic Republic of Iran, and*

Somayeh Zadehrahim

Imam Reza international University, Mashhad, Islamic Republic of Iran

International Journal of Plant Production
<https://doi.org/10.1007/s42106-018-0008-0>

ORIGINAL PAPER



Environmental and Economic Analysis of Saffron and Canola Production Systems: in East Azerbaijan Province of Iran

Arash Mohammadzadeh¹ · Abdolmajid Mahdavi Damghani¹ · Javad Vafabakhsh² · Reza Deihimfard¹

Received: 9 June 2017 / Accepted: 9 January 2018
© Springer International Publishing AG, part of Springer Nature 2018

Saffron Export and agricultural value added in Iran

Safdari Mehdi^{1,*}, Motiee Reza²

¹Department of Economics, University of Qom, Iran

²Department of Economics, Payame Noor University, Ghaemshahr, Iran

ABSTRACT

In recent years, appropriate increase of production and production for saffron export has led to seeking new export markets in Iran. The purpose of this study is to determine the relationship between Saffron export and agricultural value added in Iran. The theoretical framework was designed based on this assumption that the total production in the economy is divided into two sections: production for inside and production for export. The data were collected from 1990 to 2007 and were analyzed using Auto Regressive Distributed Lag (ARDL) model. The result of the analyses showed that there was significant relationship between Saffron export and agricultural value added. Together the independent variables explained 91% of the variance in the dependent variables. The remaining 9% was due to unidentified variables. In relation to that, we can conclude that explanatory power is high for the equation. It showed that one percent change in Saffron export rate lead to 35% in agricultural value added growth. Therefore Saffron export is regarded as an important factor in Iran's agricultural value added.

Key Words: Saffron Export, Agricultural Value Added, non oil export, Iran.

اقتصاد کشاورزی / جلد ۱۳ / شماره ۱ / صفحه های ۴۵-۲۷

بررسی تاثیر متغیرهای اقتصاد کلان (تولید داخلی، قیمت‌های نسبی و نرخ ارز) بر صادرات زعفران آرزو بهادر، سید حبیب الله موسوی، صادق خلیلیان^۱

پذیر خواهد شد. لذا در این پژوهش به بررسی متغیرهای کلان اقتصادی تاثیر گذار بر تولید و صادرات زعفران پرداخته شد. بدین منظور به مدل برنامه‌ریزی ریاضی مشتعل بر تابع‌های تولید، قیمت صادرات و عرضه صادرات این محصول برای انجام شبیه سازی‌های مورد نظر بسط یافت، در گام بعد روش و فن معادله‌های همزمان و روش 3S/LS برای برآورد فراسنجه‌های مدل بسط یافته استفاده شد. نتایج نشان داد که عواملی چون نرخ واقعی ارز، تولید داخلی، و قیمت‌های نسبی صادرات زعفران ایران را تحت تاثیر قرار می‌دهند. به طوری که تغییر در تولید داخلی ناشی از تغییر سطح زیر کشت و تغییرپذیری‌های نرخ ارز اثر مثبت و معنی‌دار بر عرضه صادرات زعفران ایران دارد در حالی که تغییر در قیمت‌های نسبی در نتیجه تغییرپذیری‌های قیمت داخلی اثر منفی بر صادرات زعفران دارد.

اقتصاد کشاورزی / جلد ۴ / شماره ۳ / صفحه‌های ۱۶۹-۱۵۳

بررسی اثر جهانی شدن بر عرضه و تقاضای صادرات زعفران

نارالله رضاپور و سید ابوالقاسم مرتضوی*

تاریخ دریافت: ۱۳۸۷/۱۱/۵ تاریخ پذیرش: ۱۳۸۹/۷/۶

چکیده

در این مطالعه اثر جهانی شدن بر عرضه و تقاضای صادرات زعفران بررسی شد. برای این منظور از الگوی معادلات هم‌زمان عرضه و تقاضای صادرات و داده‌های سری زمانی دوره‌ی ۸۴ تا ۱۳۶۱ استفاده شد. شاخص ادغام تجاری نیز به عنوان شاخص جهانی شدن مورد استفاده قرار گرفت. نتایج حاکی از با کثش بودن توابع عرضه و تقاضای صادرات زعفران نسبت به قیمت صادراتی است. همچنین متغیر شاخص جهانی شدن، در این توابع مثبت و معنادار بوده که بیانگر تاثیر مثبت افزایش رابطه‌ی مبادله با کشورها و رفع موانع تجاری، بر عرضه و تقاضای صادرات زعفران ایران است. بنابراین در پیش گرفتن سیاست‌های مناسب قیمتی و تولیدی برای توسعه‌ی صادرات این محصول، امری اجتناب‌ناپذیر خواهد بود.

اثر شوک درآمدهای نفتی بر صادرات زعفران ایران

سید حسین محمدزاده^{۱*} و علیرضا کرباسی^۲
تاریخ دریافت: ۱۱ آذر ۱۳۹۴ تاریخ پذیرش: ۵ تیر ۱۳۹۷

بررسی نقش تحریم‌های تجاری و بحران اقتصادی جهانی بر صادرات زعفران ایران

آرش دوراندیش^{۱*}، میلاد امینی زاده^۲، اندیشه ریاحی^۳ و الهام مهرپرور حسینی^۴
تاریخ دریافت: ۲۳ اردیبهشت ۱۳۹۶ تاریخ پذیرش: ۲ خرداد ۱۳۹۷

چکیده

درآمدهای نفتی نقش مهمی در اقتصاد ایران دارد. در طی سال‌های گذشته، به‌طور متوسط ۶۰٪ درآمد دولت و ۸۰٪ درآمد صادرات ایران از نفت‌وگاز بوده است. از دیگرسوی ایران به‌عنوان بزرگ‌ترین صادرکننده زعفران بخش قابل توجهی از ارزش صادراتی جهانی این محصول را به خود اختصاص داده است. با توجه به تأثیرگذاری درآمدهای نفتی در اقتصاد ایران به‌عنوان مهم‌ترین منبع درآمدی، بررسی تأثیر شوک حاصل از نوسانات این درآمدها بر اقتصاد ایران ضروری به‌نظر می‌رسد. از این رو مطالعه حاضر به بررسی اثر شوک درآمدهای نفتی بر صادرات زعفران ایران پرداخته است. در این راستا از داده‌های سری‌زمانی دوره ۹۵-۱۳۵۴ و الگوهای جوهانسون-جوسیلیوس و تصحیح خطا برای برآورد روابط بلندمدت و کوتاه‌مدت بین متغیرهای الگو استفاده شده است. یافته‌های پژوهش بیان‌گر این است که نرخ ارز مؤثر واقعی در بلندمدت و کوتاه‌مدت تأثیر معنی‌دار مثبت بر صادرات زعفران در کشور دارد. شاخص قیمت داخلی زعفران به قیمت جهانی آن و بهره‌وری زعفران نیز با این که اثرشان از لحاظ آماری معنی‌دار نیست ولی تأثیر آن از لحاظ علامت به‌ترتیب منفی و مثبت است. شوک درآمدهای نفتی نیز طبق انتظار در کوتاه‌مدت و بلندمدت دارای اثر منفی بر صادرات زعفران بوده است.

ارزیابی نقش و میزان اثرگذاری این دو مؤلفه بر صادرات زعفران ایران است. بدین منظور، صادرات زعفران به شرکای تجاری در دوره ۲۰۰۱-۲۰۱۴ با استفاده از الگوی جاذبه و برآوردگر درستمایی شبه ییسنیه بواسن مورد بررسی قرار گرفت. بر اساس نتایج، متغیرهای اندازه اقتصاد، درآمد کشورهای واردکننده و موافقت‌نامه‌های تجاری اثری فزاینده و معنی‌دار و متغیرهای فاصله و تفاوت اقتصادی اثری کاهشنده و معنی‌دار بر صادرات زعفران داشته‌اند. نتایج گویای اثر منفی و معنی‌دار تحریم‌های تجاری اتحادیه اروپا و بحران اقتصادی جهانی بر صادرات زعفران ایران است. به عبارتی سبب شرکای تجاری ایران به گونه‌ای است که بحران اقتصادی نقشی تعیین‌کننده بر صادرات زعفران دارد. از این رو، پیشنهاد می‌شود در تدوین برنامه راهبردی بلندمدت به‌منظور تقویت جایگاه ایران در بازار جهانی زعفران، نقش تحریم‌های تجاری و بحران اقتصادی و اهمیت آن دیده شود و متناسب با آن سبب پهنه‌ای از شرکای تجاری انتخاب شود.

بررسی عوامل مؤثر بر صادرات زعفران ایران به کشورهای بریکس (رهیافت پانل دیتا)

محمد آقاپور صباغی^{*}

تاریخ دریافت: ۲۶ فروردین ۱۳۹۷ تاریخ پذیرش: ۲۵ مهر ۱۳۹۷

چکیده

تحلیل عوامل مؤثر بر صادرات به‌ویژه در ارتباط با بازارهای جدید در بخش کشاورزی یکی از مهم‌ترین عوامل مؤثر بر رشد و توسعه صادرات محصولاتی مانند زعفران است. تحقیق حاضر باهدف بررسی عوامل اثرگذار بر صادرات زعفران ایران به کشورهای بریکس انجام‌یافته است. برای این منظور مدل داده‌های پانل در دوره زمانی ۲۰۱۵-۱۹۹۰ به کار گرفته شده است. نتایج برآورد الگوی تصادفی نشان می‌دهد که تولید ناخالص داخلی کشورهای بریکس، نرخ واقعی ارز و جمعیت اثر مثبت و قیمت صادراتی اثر منفی بر صادرات زعفران ایران به کشورهای بریکس دارند. با توجه به بالابودن سطح درآمد سرانه در کشورهای بریکس و اثر مثبت آن بر میزان صادرات زعفران، انجام برنامه‌ریزی و سیاست‌گذاری در جهت تقویت روابط با این کشورها، عاملی مهم در زمینه توسعه صادرات محصول زعفران خواهد بود. از سویی با توجه به کاهش کم‌قیمت وارداتی زعفران در کشورهای مذکور، پیشنهاد می‌گردد، اقدامات لازم در جهت ارتقاء و بهبود سطح بسته‌بندی و فراوری این محصول که ممکن است منجر به افزایش نسبی قیمت گردد، انجام شود.



آثار بی‌ثباتی نرخ ارز بر تقاضای صادرات سیب و سیب‌زمینی (کشورهای در حال توسعه عمده تولید کننده و صادرکننده)

محمدعلی فلاحتی^{۱*} - مسعود همایونی‌فر^۲ - زهرا یآوری^۳

تاریخ دریافت: ۱۳۹۱/۱۲/۱۲

تاریخ پذیرش: ۱۳۹۲/۸/۲۱

چکیده

با گسترش دامنه تجارت جهانی، نرخ ارز به عنوان پل ارتباطی بین اقتصادهای مختلف عمل کرده و بی‌ثباتی آن می‌تواند از طرق مختلف سطح قیمت‌ها، تولید، صادرات و واردات را متأثر سازد. هدف از مطالعه حاضر بررسی تأثیر بی‌ثباتی نرخ ارز واقعی بر تقاضای صادرات محصولات سیب و سیب‌زمینی ۹ کشور در حال توسعه‌ی تولید کننده و صادرکننده عمده این محصولات در دوره زمانی ۱۹۹۲-۲۰۰۹ می‌باشد. بدین منظور ابتدا بی‌ثباتی نرخ ارز واقعی با استفاده از الگوی واریانس ناهمسانی شرطی خودبازگشت (ARCH) محاسبه گردید. سپس اثر بی‌ثباتی نرخ ارز واقعی بر مقدار تقاضای صادراتی محصولات سیب و سیب‌زمینی با استفاده از الگوی داده‌های تابلویی بررسی شد. نتایج نشان‌دهنده تأثیر مثبت و معنی‌دار نرخ ارز واقعی و تأثیر منفی و معنی‌دار بی‌ثباتی آن بر مقدار تقاضای صادراتی این محصولات در کشورهای منتخب مورد مطالعه می‌باشد. همچنین بررسی سایر متغیرهای مدل نشان داد که میانگین وزنی درآمد واقعی کشورهای واردکننده سیب و سیب‌زمینی تأثیری مثبت و قیمت نسبی صادراتی سیب و سیب‌زمینی تأثیر منفی و معنی‌داری بر صادرات این محصولات داشته است.

واژه‌های کلیدی: بی‌ثباتی نرخ ارز، تقاضای صادرات، سیب و سیب‌زمینی، الگوی ARCH، داده‌های تابلویی

طبقه‌بندی JEL: F31، Q17

فصلنامه پژوهشنامه بازرگانی، شماره ۷۷، زمستان ۱۳۹۴، ۸۷-۱۱۴

بررسی استراتژی‌های قیمت‌گذاری صادرکنندگان ایران در بازارهای بین‌المللی (رویکردهای پویای داده‌های تابلویی)^۱

محمد قربانی*

امیرحسین توحیدی**

تغییرات نرخ ارز بر سیاست‌ها و استراتژی‌های قیمت‌گذاری صادرکنندگان ایران در بازارهای بین‌المللی نقش بسیار مهمی ایفا می‌کند. بنابراین، بررسی درجه قیمت‌گذاری برای بازار توسط صادرکنندگان ایران در ۴۸ بازار مقصد در دوره ۹۱-۱۳۷۱ هدف اصلی این مطالعه است. وجه تمایز این مطالعه نسبت به مطالعات پیشین استفاده از روش‌های پیشرفته و پویای داده‌های تابلویی (نظیر میان‌گروهی تلفیقی، گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی و اثرات ثابت پویا) برای تعیین عوامل مؤثر بر قیمت صادرات ایران است که در چارچوب مدل‌های خودتوضیح برداری با وقفه‌های توزیعی و تصحیح خطای برداری الگوسازی شده‌اند. افزون بر این، در چارچوب داده‌های تابلویی از روش گارچ‌نمایی برای بررسی اثر ناطمینانی نرخ ارز نیز استفاده شده است. نتایج مطالعه نشان داد در کوتاه‌مدت درجه قیمت‌گذاری برای بازار با استفاده از سه روش مذکور در محدوده‌ای بین ۰/۴۶ تا ۰/۹۴ قرار دارد و بنابراین

تحلیل اقتصادی آثار کوتاه‌مدت و بلندمدت نا اطمینانی نرخ ارز بر صادرات زعفران ایران

اسماعیل فلاحی^{۱*} و فاطمه مزرعه^۲

تاریخ دریافت: ۷ مهر ۱۳۹۶ تاریخ پذیرش: ۲ خرداد ۱۳۹۷

فلاحی، ا. و مزرعه، ف. ۱۳۹۷. تحلیل اقتصادی آثار کوتاه‌مدت و بلندمدت نا اطمینانی نرخ ارز بر صادرات زعفران ایران. *زراعت و فناوری زعفران*، ۶(۳): ۳۸۱-۳۶۷.

چکیده

تجارت محصولات کشاورزی باهدف رهایی از اقتصاد تک‌محصولی، در اسناد بالادستی کشور مورد تأکید قرار گرفته است. در این راستا، تحلیل اثر عوامل مؤثر بر صادرات محصول راهبردی زعفران ایران به‌عنوان بزرگ‌ترین تولیدکننده و صادرکننده این محصول در جهان، می‌تواند منجر به کسب بیش به‌منظور سیاست‌گذاری بهتر گردد. بر این اساس، مطالعه‌ی حاضر باهدف بررسی آثار کوتاه‌مدت و بلندمدت نوسانات نرخ ارز در کنار سایر عوامل مؤثر بر صادرات این محصول، داده‌های پانل مربوط به شرکای عمده تجاری ایران را در طی دوره ۹۳-۱۳۷۱ به‌کار بست. بدین منظور و برای ممانعت از محدودیت روش‌های متقارن محاسبه‌ی شاخص‌های بی‌ثباتی، ابتدا شاخص نوسانات نرخ ارز با استفاده از روش نامتقارن الگوی واریانس ناهمسانی شرطی خود رگرسیونی تعمیم‌یافته‌ی نمایی (EGARCH) محاسبه گردید. سپس با ورود این شاخص در کنار سایر متغیرهای الگو، روش حداقل مربعات معمولی کاملاً تعدیل‌شده (FMOLS) جهت برآورد الگوی پیشنهادی، مورد استفاده قرار گرفت. نتایج حاکی از آن است که در بلندمدت، علی‌رغم تأثیر مثبت و معنی‌دار متغیرهای درآمد کشورها و نرخ ارز واقعی بر صادرات محصول زعفران، متغیر نوسانات نرخ ارز دارای تأثیر منفی و معنی‌داری بر صادرات این محصول می‌باشد. از این رو، چنانچه هدف دولت حمایت از صادرات این محصول باشد، برقراری ثبات در بازار نرخ ارز امری ضروری است. همچنین نتایج برآورد الگوی تصحیح خطا نشان‌دهنده‌ی سرعت قابل‌ملاحظه‌ی تعدیل خطای عدم تعادل و گرایش به سمت روابط تعادلی بلندمدت بوده و از این رو می‌توان به تأثیر سیاست‌گذاری در کوتاه‌مدت به‌منظور مدیریت مسائل مورد بحث امیدوار بود.

بررسی تجربی اثر نوسانات نرخ ارز بر تقاضای صادرات زعفران ایران: رویکرد پویای میان گروهی تلفیقی (PMG)

محمدرضا کهنسال^{۱*} و امیرحسین توحیدی^۲

تاریخ دریافت: ۴ شهریور ۱۳۹۳

تاریخ پذیرش: ۲۹ اسفند ۱۳۹۳

چکیده

نوسانات نرخ ارز به عنوان یک منبع ایجاد ریسک و نااطمینانی اثر بسیار مهمی بر حجم تجارت بین‌الملل و متعاقب آن بر تراز پرداخت‌ها دارد. با توجه به جایگاه مهم زعفران در صادرات غیرنفتی ایران، هدف اصلی این مطالعه بررسی تجربی اثر نوسانات نرخ ارز بر تقاضای صادرات زعفران ایران در ۱۷ بازار مقصد طی دوره‌ی ۹۱-۱۳۷۱ است. استفاده از برآوردگر میان گروهی تلفیقی (PMG) و گارچ نمایی (EGARCH) در چارچوب داده‌های تابلویی وجه تمایز این مطالعه نسبت به مطالعات پیشین است تا بتوان روابط کوتاه‌مدت و بلندمدت تقاضای صادرات زعفران ایران را برآورد نمود. با در نظر گرفتن سایر تعیین‌کننده‌های تقاضای صادرات، نتایج مطالعه نشان داد، نوسانات نرخ ارز به طور معنی‌داری در بلندمدت اثر مثبتی بر تقاضای صادرات زعفران ایران دارد و این در حالی است که اثر کوتاه‌مدت آن منفی است. بنابراین، شفاف‌سازی سیاست‌های ارزی (به خصوص در دوره‌های کوتاه‌مدت) و توسعه بازارهای سلف ارزی نقش بسیار مهمی در جهت کاهش درجه‌ی ریسک-گزیزی صادرکنندگان ایران و افزایش صادرات زعفران در بازارهای جهانی ایفا می‌نمایند.

THRESHOLD EFFECTS OF INFLATION ON ECONOMIC GROWTH: EVIDENCE FROM DYNAMIC PANEL THRESHOLD REGRESSION ANALYSIS FOR 18 DEVELOPED ECONOMIES

*Jenq Fei Chu**

*Sioh Kun Sek**

*Mohd Tahir Ismail**

*School of Mathematical Sciences, Universiti Sains Malaysia, Malaysia

<http://doi.org/10.31039/jomeino.2019.3.1.4>

Table 2. Results of dynamic panel threshold estimation in 18 developed countries

Threshold Estimated		
γ	1.4375	
95% Confidence interval	[1.3830, 3.2627]	
Impact of regime-dependent regressors: inflation, π		
	Estimated coefficients	Standard errors
β_1	2.4863**	1.1967
β_2	-1.3931***	0.4336
Impact of regime-independent regressors		
	Estimated coefficients	Standard errors
$initial_{it}$	-9.0242**	4.4594
$lppi_{it}$	3.8354	5.5412
lex_{it}	11.2536*	6.5937
lto_{it}	-2.7885	5.5496
ir_{it}	-0.3710	0.2995
pop_{it}	3.3738	2.1726
δ_1	-10.0608***	1.5131
Observations	144	
N	18	

Notes: */**/** indicate significant at the 10/5/1% level respectively.

دانشگاه علامه طباطبائی

دانشکده اقتصاد

پایان نامه کارشناسی ارشد رشته اقتصاد محیط زیست

موضوع:

«بررسی اثر آستانه‌ای توسعه مالی بر کیفیت محیط‌زیست در کشورهای با درآمد متوسط "رهیافت مدل رگرسیون انتقال ملایم تابلویی (PSTR)"»

استاد راهنما:

دکتر تیمور محمدی

استاد مشاور:

دکتر حمیدرضا اریاب

پژوهشگر:

یوسف کریمی

بهمن‌ماه ۱۳۹۵

دانشگاه علامه طباطبائی

دانشکده اقتصاد

پایان نامه کارشناسی ارشد رشته توسعه اقتصادی و برنامه‌ریزی

موضوع:

«بررسی اثر آستانه‌ای نرخ تورم بر ازدواج در استان‌های ایران "رهیافت مدل رگرسیون انتقال ملایم تابلویی (PSTR)"»

استاد راهنما:

دکتر تیمور محمدی

استاد مشاور:

دکتر مهتوش عبدالله میلانی

پژوهشگر:

شریف محمدی

دی ماه ۱۳۹۵

دانشگاه ارومیه

دانشکده اقتصاد و مدیریت

گروه اقتصاد

پایان‌نامه جهت اخذ درجه کارشناسی ارشد رشته علوم اقتصادی

عنوان:

بررسی رابطه‌ی غیر خطی بین رافت نفتی و رشد اقتصادی در کشورهای صادرکننده نفت: مدل رگرسیون انتقال ملایم پانلی

استاد راهنما:

دکتر کیومرث شهبازی

استاد داور:

دکتر یوسف محمدزاده

تنظیم و نگارش:

کالی حسن زاده

شهریور ۱۳۹۵

دکتر صمد حکمتی فرید

دکتر خلیل جهانگیری

تحقیقات اقتصادی / دوره ۵۳، شماره ۴، زمستان ۹۷ / ص ۸۸۱-۹۱۰

بررسی تأثیر سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی بر رشد اقتصادی با تأکید بر نقش منابع طبیعی (کاربرد مدل رگرسیون حد آستانه در داده‌های پانل)

فرهاد قلمباز^{۱*}، علی سوری^۲، قهرمان عبدلی^۳، محسن ابراهیمی^۴
۱. دانشجوی دکتری علوم اقتصادی - اقتصاد مالی، پردیس بین‌الملل کیش، دانشگاه تهران،



فصلنامه اقتصاد مالی
سال سیزدهم / شماره ۴۶ / بهار ۱۳۹۸
صفحه ۷۳ تا ۹۴

بررسی اثر ساختار سرمایه بر سودآوری شرکت‌های کشورهای جنوب شرق آسیا (بر اساس رویکرد رگرسیون پنل آستانه‌ای)

علی نعمتی^۱

علی باغانی^۲

قدرت‌اله امام وردی^۳

رویا دارابی^۴

نوروز نوراله‌زاده^۵

تاریخ دریافت: ۱۳۹۷/۱۰/۱۲ تاریخ پذیرش: ۱۳۹۷/۱۲/۱۳

جدول ۲- آزمایش اثر آستانه‌ای

Test for Single Threshold	
F_1	161.38
Bootstrapped p-value for one break	0.00
Test for Single Threshold	
F_2	36.32
Bootstrapped p-value For tow breaks	0.00

مأخذ: یافته‌های پژوهشگر

جدول ۳- تخمین آستانه

λ_1	0.128
λ_2	0.33

مأخذ: یافته‌های پژوهشگر

جمع بندی ادبیات موضوع

به طور کلی، نتایج اکثر مطالعات بیان گر این است که نوسانات نرخ ارز بر حجم تبادلات بین الملل تاثیرگذار بوده و به نوعی معنی دار است.



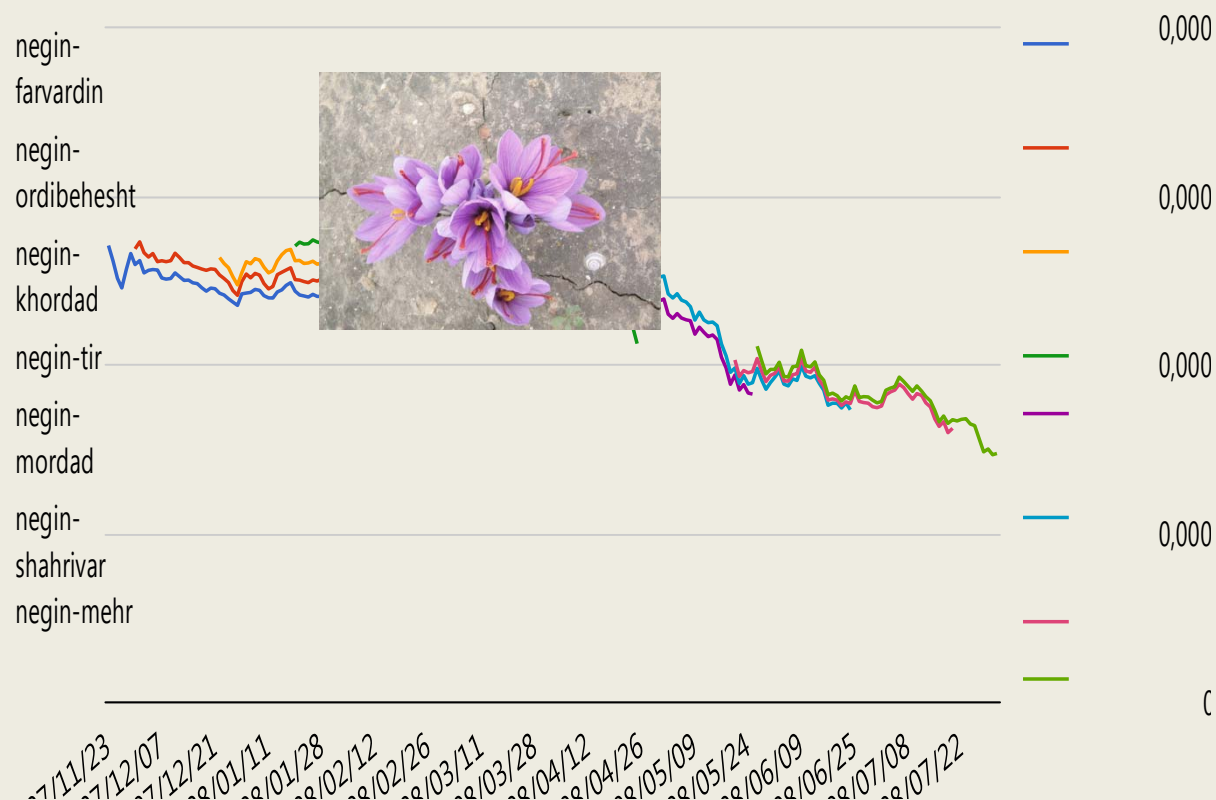
این وجود توافق نظری در مورد جهت و میزان اثر نوسانات نرخ ارز بر تقاضای صادراتی و حجم تجارت به طور حتم بواسطه وجود عوامل متعدد به طور کامل وجود ندارد.



بر اساس نتایج بخشی از این عوامل متعدد می توان به نگرش صادرکنندگان به ریسک، نوع معامله، طول دوره ی زمانی، وجود هزینه های تعدیل ساختار بازار و نوع نگرش تئوریکال عدم در نظر گرفتن پویایی های تعدیل و ارتباط خطی و غیرخطی متغیرهای موثر و به تبع آن انتخاب مدل مناسب سری زمانی و... نام برد.



روش تحقیق



کتابخانه‌ای و اسنادی

دوره تحقیق ۹۶-۱۳۶۹

۱۵ کشور منتخب از ۱۸ کشور متقاضی
زعفران ایران

خلاصه ای آسان از متدولوژی مدل های پانلی خطی و غیرخطی

- در ادبیات اقتصادسنجی، اطلاعات آماری به سه دسته: الف) سری زمانی، ب) مقطعی و ج) ترکیبی تقسیم می‌شوند.
- منظور از اطلاعات سری زمانی، اندازه‌گیری و ثبت مقدار یک متغیر در دوره‌ای از زمان است و منظور از اطلاعات مقطعی، اندازه‌گیری یک متغیر در یک زمان برای واحدهای متفاوت است.
- داده‌های پانلی (ترکیبی) اطلاعات آگاهی‌دهنده بیشتر، تنوع یا تغییرپذیری بیشتر را معمولاً شامل می‌شود چرا که ترکیبی از سریهای زمانی و مقطعی می‌باشد، بعد مقطعی موجب اضافه شدن تغییرپذیری یا تنوع بسیار زیادی می‌شود که با در دست داشتن این اطلاعات می‌توان برآوردهای معتبرتری انجام داد.
- اولین و به قولی ساده ترین مدل های پانلی، مدل‌های اثرات ثابت هستند و به کارگیری آن در زمانی است که ما اطمینان داشته باشیم که اختلاف بین مقاطع را می‌توان به صورت انتقال تابع رگرسیون (عرض از مبدا متفاوت) نشان داد، در حالیکه ما همیشه از وجود این موضوع مطمئن نیستیم. لذا روش‌های دیگر مورد استفاده قرار می‌گیرند. روش دیگر برآورد، روش اثرات تصادفی است که فرض می‌کند جزء ثابت مشخص‌کننده مقاطع مختلف به صورت تصادفی بین واحدها و مناطق توزیع شده است.
- مدل های بعدی پانلی مدل های با متغیرهای اتورگرسیو توزیعی می باشد.

• ۱-۳- مدل پائل خطی میانگین گروهی تلفیقی (PMG)

- به طور کلی مدل های ایستا از انباشتن داده های گروهی از صنایع کشورها یا خانوار ها (N) در طول زمان (T) حاصل می شود و مبنای بسیار مساعدی برای تحقیقات اقتصاد سنجی کاربردی بوجود می آورد . به هر حال با مدل های ایستا فقط می توان روابط ایستا را تخمین زد و برای برآورد روابط پویا که قادر است پویایی های کوتاه مدت و بلند مدت را از یکدیگر تفکیک کند و در مورد سیاست گذاری متغیرهای مهم در زمان های خاص تحلیلی به دست دهد، باید برآوردهای پویا را مورد استفاده قرار داد.
- در مطالعات اقتصادی گاهی لازم است ناهمگنی های بیشتری را در نظر گرفت تا از این طریق بتوان ضرایب مربوط به گروه های مختلف را بدست آورد . برآوردهای میان گروهی و میان گروهی تلفیقی ناهمگنی های بیشتری را در مدل داده های تابلویی در نظر می گیرند و با متوسط گیری از پارامترهای مدل خود توضیح برداری با وقفه های توزیعی برای هر مقطع I ، برآوردهای MG رابطه بلندمدت را محاسبه می کند .
- تلفیق پارامترهای بلند مدت و تخمین مدل به صورت یک سیستم از سوی پسران و همکاران به روش PMG نامیده شد در واقع این روش از کارایی برآورد تلفیقی استفاده می کند ، برون آنکه ناسازگاری بواسطه روابط پویای ناهگن وجود داشته باشد .
- برآوردهای PMG حدواسط دو روش MG (که در آن ضرایب شیب و عرض از مبدا ها میان مقاطع متفاوتند) و روش اثرات ثابت (که در آن ضرایب شیب ثابت و عرض از مبدا ها میان مقاطع متفاوتند) است . در برآورد به روش PMG، ضرایب بلند مدت میان کشورها یکسان است ، در حالی که ضرایب کوتاه مدت قابلیت تغییر دارند .

روش پانل غیرخطی رگرسیون انتقال ملایم (هانسن، ۱۹۹۹)

- تجزیه و تحلیل سنتی روابط غیرخطی معمولاً بر اساس رهیافت تقسیم نمونه به دو گروه به صورت برون‌زا است که بر پایه‌ی داوری و ترجیحات فردی استوار است. در صورت استفاده از این روش، انتخاب تعداد رژیم‌ها و محل آن اختیاری و بر اساس راهنمایی‌های نظریات اقتصادی قبلی است. لذا در این صورت، صحت نتایج و پارامترهای تخمین زده شده سؤال برانگیز است، زیرا به طور وسیعی به انتخاب نقطه‌ای که آستانه در آنجا رخ می‌دهد، وابسته است.
- روش رگرسیون آستانه‌ای ارائه شده توسط هانسن (۱۹۹۹)، به دنبال پاسخ به این سوال است که آیا توابع رگرسیونی به طور یکنواخت از همه‌ی مشاهدات عبور می‌کند یا می‌تواند به گروه‌های مجزا شکسته شوند؟

- اگر داده‌های ترکیبی متوازن به صورت $\{T > n, 1 \leq t \leq T: x_{it}, q_{it}, y_{it}\}$ باشند که اندیس i نشان‌دهنده مقاطع و اندیس t نمایانگر زمان است. متغیر وابسته y_{it} و متغیر آستانه‌ای q_{it} اسکالر هستند در صورتی که رگرسور x_{it} یک بردار است. فرم ساختاری این مدل به صورت زیر می‌باشد:

$$y_{it} = \mu_i + \beta_1' x_{it} I(q_{it} \leq \gamma) + \beta_2' x_{it} I(q_{it} > \gamma) + e_{it}$$

(۲۹)

- مشاهدات بر اساس اینکه متغیر آستانه کمتر یا بیشتر از γ آستانه‌ای است، به دو رژیم تقسیم می‌شوند. این رژیم‌ها توسط تفاوت شیب‌های رگرسیون و مشخص می‌شوند. شناسایی و مستلزم آن است که عناصر در طول زمان تغییرناپذیر نباشند. همچنین فرض شده است که متغیر آستانه‌ای نیز در طول زمان تغییرناپذیر نیست. در مورد جمله‌ی خطای، فرض شده است که غیروابسته و به طور یکسان توزیع شده است و دارای میانگین صفر و واریانس محدود σ^2 است.

$$v_{it} = \begin{cases} \mu_i + \theta' h_{it} + \alpha_1 d_{it} + \varepsilon_{it} & \text{if } d_{it} \leq \gamma \\ \mu_i + \theta' h_{it} + \alpha_2 d_{it} + \varepsilon_{it} & \text{if } d_{it} > \gamma \end{cases}$$

پس از تعیین نقاط آستانه‌ای به روش هانسن مدل این تحقیق به شرح ذیل برآورد می‌شود:

(۳۰)

$$\theta = (\theta_1, \theta_2, \theta_3, \theta_4)', \quad h_{it} = (s_{it}, m_{it}, g_{it}, c_{it})'$$

• مبانی نظری و تصریح مدل

- همان‌طور که مطرح شد هدف از انجام این مطالعه برآورد مدل تقاضای صادرات زعفران می‌باشد لذا برای این منظور در این قسمت در ابتدا چگونگی تخمین توابع تقاضای زعفران بحث می‌شود. (کهنسال و توحیدی ۱۳۹۴)
- (کهنسال)
- ب

$$\ln E_{it} = \mu_i + \beta_1 \ln P_{it} + \beta_2 \ln Y_{it} + \beta_3 \ln ER_t + \beta_4 \ln V_t + \lambda \ln E_{i,t-1} + U_{it}$$

که $\ln E_{it}$ لگاریتم صادرات زعفران ایران به کشور i در زمان t
 $\ln P_{it}$ لگاریتم نسبت قیمت صادرات زعفران ایران به قیمت صادرات زعفران اسپانیا (رقیب اصلی ایران در صادرات زعفران) در بازار i در زمان t
 $\ln Y_{it}$ لگاریتم تولید ناخالص داخلی کشور i در زمان t (به عنوان جانشینی برای درآمد واقعی کشور واردکننده)، $\ln ER_t$ نرخ ارز رسمی در زمان t (ارزش دلار آمریکا بر حسب ریال)، $\ln V_t$ لگاریتم نوسانات نرخ ارز (به عنوان جانشینی برای نااطمینانی نرخ ارز) در زمان t و U_{it} جمله خطای رگرسیون، μ_i اثرات خاص کشوری است.

• بر اساس مقاله

•
•
•

$$\ln rex = a_0 + a_1 \ln sbt + a_2 \ln pp + a_3 \ln arzrsmi + a_4 \ln vol + U_{it}$$

$\ln rex$ = لگاریتم صادرات زعفران ایران به کشور i در زمان t
 $\ln sbt$ = لگاریتم نسبت قیمت صادرات زعفران ایران به قیمت صادرات زعفران اسپانیادر بازار i در زمان t

$\ln pp$ = لگاریتم درآمد ناخالص داخلی کشور i در زمان t (به عنوان جانشینی برای درآمد واقعی کشور وارد کننده

$\ln arzrsmi$ = لگاریتم نرخ ارز رسمی در زمان t (ارزش دلار آمریکا بر حسب ریال)

$\ln vol$ = لگاریتم نوسانات نرخ ارز (به عنوان جانشینی برای نااطمینانی نرخ ارز) در زمان t
 U_{it} = جمله خطای رگرسیونی

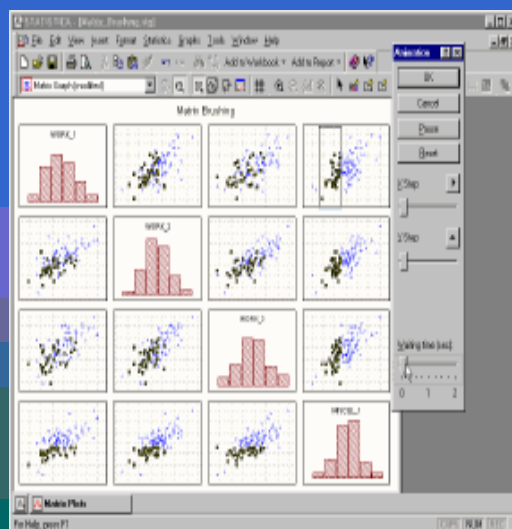
مبانی نظری مدل EGARCH

$$\ln ER_t = \alpha_0 + \alpha_1 \ln ER_{t-1} + \varepsilon_t \quad (2)$$

$$\ln \sigma_t^2 = \omega + \sum_{j=1}^q \kappa_j \ln(\sigma_{t-j}^2) + \sum_{i=1}^p \zeta_i \left| \frac{\varepsilon_{t-i}}{\sigma_{t-i}} \right| + \sum_{k=1}^r \vartheta \frac{\varepsilon_{t-k}}{\sigma_{t-k}} \quad (3)$$

که ε_t جمله خطای رگرسیون (۲)، $\ln \sigma_t^2$ لگاریتم سری واریانس شرطی، ω ، κ ، ζ و ϑ ضرایب برآوردی می‌باشند. توان دوم در سمت چپ معادله، واریانس‌های شرطی غیرمنفی را محاسبه می‌کند که از مقادیر به دست آمده، به عنوان شاخص نااطمینانی نرخ ارز در معادله (۱) استفاده می‌شود.

نتایج حاصل از
اجرای مدل های
خطی و غیر خطی
اقتصاد سنجی پانلی



نتایج و خروجی مدل‌های مدنظر

جدول ۱-۴ آزمون‌های ریشه واحد شین و پسران () و لوین چو (LLC)

جدول ۱-۴ آزمون‌های ریشه واحد شین و پسران (IPS) و لوین چو (LLC)

متغیرها	آزمون LLC		آزمون IPS	
	احتمال	آماره	احتمال	آماره
lgrex	۰/۱۲	-۱/۲۲	۰/۰۶	-۲/۶۱
dlgrex	۰/۰۰	-۴/۸۶	۰/۰۰	-۸/۲۵
lpp	۰/۱۱	-۱/۲۸	۰/۰۴	-۲/۰۶
dlpp	۰/۰۰	-۳/۰۹	۰/۰۰	-۶/۰۶
lvol	۰/۹۳	-۱/۵۲	۰/۰۶	-۲/۶۲
dlvol	۰/۰۲	-۱/۸۸	۰/۰۰	-۹/۰۶
lnarzrsmi	۰/۰۰	-۳/۷۳	۰/۰۰	-۲/۱۴
lnsbt	۰/۰۰	-۴/۱۴	۰/۰۰	-۳/۳۲

مأخذ: نتایج پژوهش و بر اساس نرم افزار STATA15



مدل هم‌انباشتگی کائو

- بر اساس نتایج حاصل از آزمون هم‌انباشتگی کائو در جدول (۲-۴) می‌توان بیان کرد که مقدار آماره t آزمون کائو در سطح ۹۵ درصد وجود هم‌مجمعی را تایید می‌کند و بنابراین یک رابطه تعادلی بلندمدت بین تقاضای صادراتی زعفران و متغیرهای مستقل مدل وجود دارد و رگرسیون برآوردی کاذب نخواهد بود، لذا تحلیل نتایج حاصل از برآوردها کاملاً صحیح و بدور از مسائل کاذب بودن و دارای اعتماد هستند.

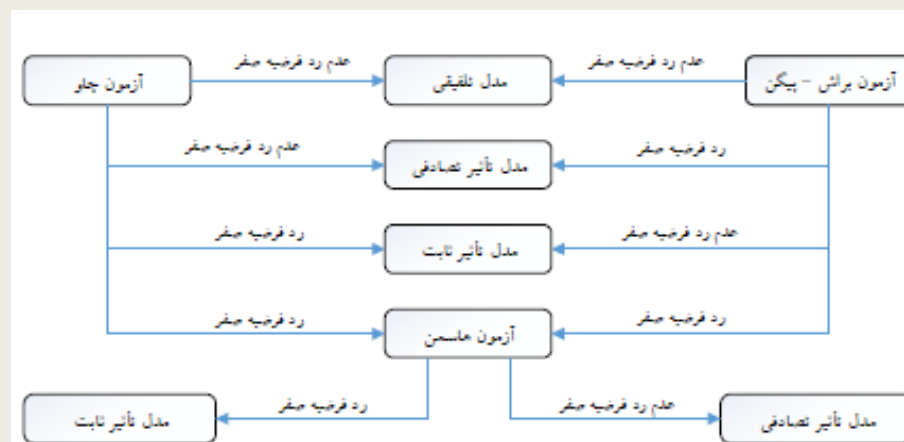
جدول (۲-۴): نتایج آزمون هم‌انباشتگی کائو

نام آزمون	آماره ADF	نتیجه‌گیری
هم‌مجمعی تقاضای	-۵/۶۹	رابطه هم‌انباشتگی وجود دارد
صادراتی زعفران	(۰/۰۰)	

منبع: یافته‌های پژوهش



وزارت جهاد کشاورزی
موسسه پژوهش‌های برنامه‌ریزی، اقتصاد کشاورزی و توسعه روستایی



جدول (۳-۴): نتایج آزمون F لیمر

```
corr(u i, Xb) = -0.7300
```

F(4, 421)	=	30.57
Prob > F	=	0.0000

lgrexp	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]	
larzrsmi	.4365807	.0822232	5.31	0.000	.2749616	.5981999
lnsbt	.5844939	.1328737	4.40	0.000	.3233154	.8456725
lpp	3.699758	.5721396	6.47	0.000	2.575152	4.824364
lvcl	-.0001085	.0211125	-0.01	0.996	-.0416322	.0414151
_cons	-15.71261	2.483514	-6.33	0.000	-20.59424	-10.83098
sigma_u	1.2194047					
sigma_e	.62164554					
rho	.79371995	(fraction of variance due to u_i)				

F test that all u_i=0: F(16, 421) = 44.99 Prob > F = 0.0000

منبع : یافته‌های پژوهش

نتایج آزمون هاسمن

- با توجه به اینکه بر طبق آزمون چاو (F لیمر) اثرات ترکیبی بر (pooling) ترجیح دارد و براساس آزمون هاسمن اثرات ثابت بر اثرات تصادفی ترجیح دارد، بنابراین نیازی به آزمون بریوش-پاگان برای تعیین مدل به صورت ترکیبی یا اثرات تصادفی نیست.
- در نهایت با توجه به اینکه، مدل به صورت اثرات ثابت تخمین زده شده است، لذا از آزمون‌های خودهمبستگی برای تعیین دقت استفاده کرد.

جدول ۴-۴ نشان می‌دهد که اثرات ثابت بر اثرات تصادفی برای هر تمام مدل‌ها ترجیح دارند.

جدول (۴-۴): نتایج آزمون هاسمن

نوع متغیر وابسته	آزمون هاسمن	نتیجه
lgexp	۰.۶۹	مدل مبتنی بر اثرات
	(۰/۰۴)	ثابت ترجیح دارد.

منبع: یافته‌های پژوهش

جدول (۴-۶): نتایج حاصل از تخمین مدل نهایی PMG

نام متغیر	دوره زمانی	مقدار برآوردی	ارزش احتمال
Insbt	بلند مدت	۰,۳۱۱۵۰۹۳	۰,۰۱۴
	کوتاه مدت	۰,۱۶۶۱۱۶۱	۰,۱۱۲
Inpp	بلند مدت	۰,۲۳۹۴۱۵۳	۰,۷۸۴
	کوتاه مدت	۳,۴۳۳۲۲۵۱	۰,۰۲۱
Inarzrsm	بلند مدت	۰,۶۷۳۶۹۰۷	۰,۰۰۰
	کوتاه مدت	۰,۱۸۶۶۵۲۵	۰,۲۲۰
Invol	بلند مدت	۰,۱۶۸۰۰۳۸	۰,۰۰۰
	کوتاه مدت	۰,۰۴۱۶۷۸۸	۰,۰۰۳
جمله تصحیح خطا		۰,۳۲۹۲۶۳۹	
عرض از مبدا		۰,۷۱۳۶۲۲۰	

```
chi2(4) = (b-B)'[(V_b-V_B)^(-1)](b-B)
          = 1.95
Prob>chi2 = 0.7453
```

منبع: یافته‌های پژوهش

آزمون غیر خطی مدل PSTR

جدول (۴-۵): نحوه انتخاب تعداد ناحیه (رژیم)

Threshold	RSS	MSE	Fstat	Prob	Crit10	Crit5	Crit1
Single	53.7280	0.1343	266.07	0.0000	21.2210	24.1096	30.5438
Double	41.6177	0.1040	116.40	0.0000	17.4795	21.2870	26.5263

منبع: یافته‌های پژوهش

جدول (۴-۶): نحوه انتخاب تعداد ناحیه (رژیم)

Threshold estimator (level = 95):

model	Threshold	Lower	Upper
Th-1	1.1900	0.6900	1.3200
Th-21	1.1900	0.6900	1.3200
Th-22	2.1600	2.1200	2.1900

منبع: یافته‌های پژوهش

• جدول (۷-۴): نتایج حاصل از تخمین مدل نهایی پانل آستانه‌ای

corr(u_i, Xb) = -0.2589				F(7, 401) = 209.93		Prob > F = 0.0000	
lgrexp	Coef.	Std. Err.	t	P> t	[95% Conf. Interval]		
lpp	.3925064	.3303525	2.10	0.037	.0430673	1.341945	
lnsbt	.0702922	.0772582	0.91	0.363	-.0815895	.222174	
lgrexp L1.	.4117514	.029777	13.83	0.000	.3532128	.47029	
larzrsmil	.0628362	.0457813	1.37	0.071	-.0271651	.1528374	
_cat#c.lvol 0	-.2453857	.0225948	-15.29	0.000	.3898048	-.3009666	←
1	-.0654131	.0171331	-3.82	0.000	.0990951	-.0317312	
2	.0399104	.0147038	2.71	0.007	.0110042	.0688166	
_cons	-1.70368	1.437424	-1.19	0.237	-4.529508	1.122148	
sigma_u	.46245745						
sigma_e	.32215662						
rho	.67327465	(fraction of variance due to u_i)					
F test that all u_i=0: F(16, 401) = 14.62				Prob > F = 0.0000			



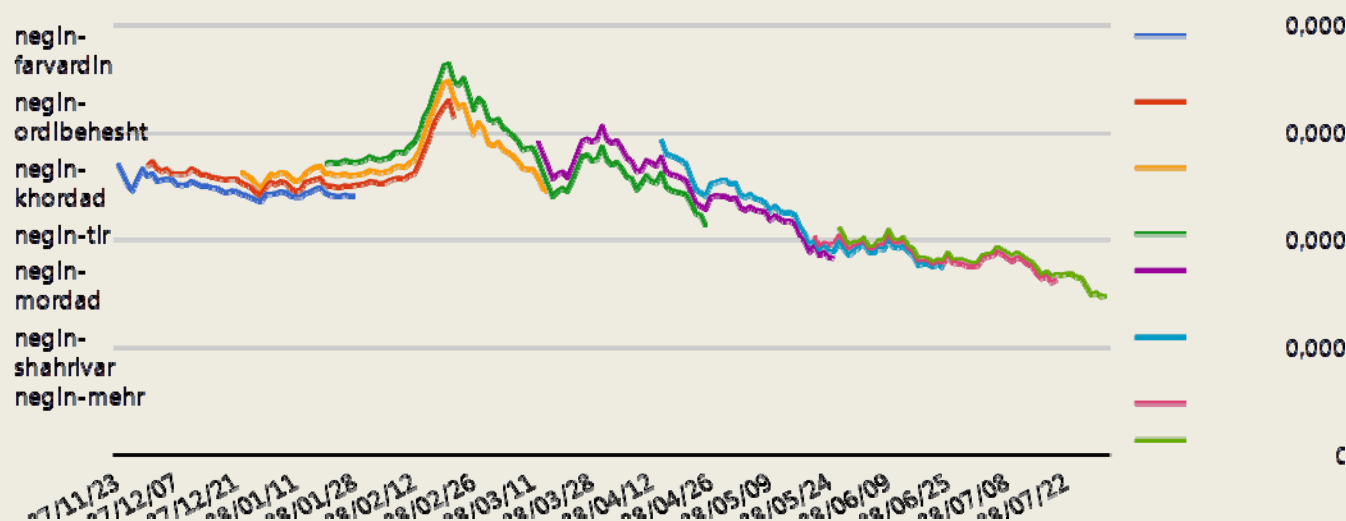
۱. بر اساس نتایج طرح می‌توان بیان داشت که، افزایش نرخ ارز در کوتاه مدت به طور ناگهانی زمینه افزایش هزینه‌های تولید، عدم پذیرش و مدیریت ریسک افزایش قیمت از سوی بیشتر تولید کنندگان و بالتبع آن صادرکنندگان خرد زمینه کاهش صادرات را بدنبال دارد، لیکن در بلند مدت با تثبیت قیمت نهاده‌های تولید و مشخص شدن اثرات نرخ ارز در تعیین با ثبات قیمت محصول زعفران زمینه افزایش صادرات را بدنبال داذافزایش می‌یابد. بنابراین پیشنهاد می‌شود که دولت به دنبال سیاستهایی جهت تثبیت نرخ ارز باشد. حذف نوسانات موقت و لحظه‌ای در بازار ارز، حفظ نوسانات نرخ ارز در محدوده قابل قبول، بهبود در ارائه خدمات ارزی، توسعه بازارهای سلف ارز، شفاف کردن سیاستهای ارزی، و مدیریت به موقع تقاضای ارز به طور حتم برای بهبود جایگاه صادرکنندگان از سهم جهانی میزان صادرات محصول زعفران مثمره ثمر خواهد بود.

۱. نتایج مطالعه نشان می‌دهد که تقاضای صادرات زعفران ایران در کوتاه‌مدت و بلندمدت نسبت به تغییرات قیمتی تقریباً کشش ناپذیر است بنابراین برای افزایش صادرات می‌توان از سایر روش‌ها به مانند افزایش کیفیت در انطباق با استانداردهای کشورهای متقاضی زعفران نوع نگهداری و بسته بندی و نهایتاً روش‌های علمی تبلیغات و... اقدام نمود.

۱. با توجه به اثرگذاری مثبت درآمدهای کشورهای متقاضی زعفران می‌توان با اتخاذ سیاست‌های کوتاه مدت نسبت به جذب منافع بیشتر از طریق انتخاب شریک تجاری خارجی قوی در کشورهای هدف به منظور جذب ارزش افزوده بالا، علیرغم عدم وجود ساختارهای لازم (به مانند برندینگ زعفران ملی ایران) با قید تامین نهاده ممتاز در سود حاصل از فرآوری و صادرات مجدد آن اقدام نمود.

۲. با کاهش هزینه‌های تولید زعفران از طریق ساماندهی شبکه‌های تولید و احیانا شناسایی قطب‌های تولید و بالتبع، کاهش قیمت صادراتی محصول زعفران، می‌توان تقاضای صادراتی را با وجود افزایش تقاضای کشورها در زمان‌های بحرانی (افزایش ناگهانی قیمت ارزهای خارجی) به نفع تولیدکنندگان در جهت ایجاد تعادل قیمتی باثبات نمود.

۱. بازار آتی و اختیار معامله برای اولین بار در دنیا در بورس کالایی ایران برای زعفران راه اندازی شد، لیکن پرواضح است که پشتیبانی علمی قوی در شناخت امان‌های مهم در مدیریت بازارگردانی رینگ زعفران به منظور رونق در راستای تامین منافع شرکت کنندگان بازار گه بعضاً تولیدکنندگان نیز می‌باشند بواسطه تغییرات شدید قیمتی ضروری است که ارتباط رینگ صادر آتی زعفران نیز محقق شود.





باسمه تعالی
فرم پیشنهاد پژوهش (پروپوزال)

عنوان پژوهش به فارسی

طراحی مدل پیش بینی قیمت قراردادهای آتی
زعفران در بورس کالای کشاورزی

کلید واژه‌های فارسی: قراردادهای آتی، پیش‌بینی، داده‌کاوی، اقتصادسنجی، بورس کالای کشاورزی، مدل هیبریدی، مدل فازی، مدل ماشین بردار پشتیبان، مدل ژنتیک، مدل شبکه عصبی، نوفه زدایی داده، مدل موجک، زعفران

عنوان پژوهش به انگلیسی:

**Designing a Model for Forecasting the Future Prices Contract of
Saffron in the Agricultural Stock**

Keywords: Future Prices, Forecasting, Data Mining models, Econometric, Agricultural Stock, Hybrid model, Fuzzy model, Support Vector Machines, Genetic Algorithm, Neural Network, Denoised data, Wavelet Transform, Saffron

کدپژوهش

RP-98 -4-1-1347

با تشکر از توجه شما

