

بررسی رابطه بلند مدت قیمت تولید مصرف شیر با استفاده از الگوی غیر خطی مارکف سوئیچینگ

یوسف رستمی ، سید صفدر حسینی و رضا مقدسی

چکیده

این مقاله رابطه بلند مدت بین قیمت تولید کننده گان و مصرف کنندگان در بازار شیر ایران را بررسی می کند. در این مطالعه از مدل تصحیح خطای برداری مارکف سوئیچینگ و داده های ماهانه قیمت شیر از فروردین ۱۳۸۲ لغایت آذر ۱۳۹۴ استفاده شده است. الگوی فوق اجازه بررسی رابطه چند رژیمی بین قیمت تولید کننده و قیمت خرده فروشی را می دهد. بر اساس آزمون علیت گرنجر یک رابطه علی یک طرفه از قیمت تولید کننده به قیمت خرده فروشی تایید گردید. لذا تغییر قیمت تولید کننده عاملی برای تغییر قیمت خرده فروشی شیر تلقی می گردد. نتایج اصلی نشان می دهد یک رابطه مثبت نامتقارن در بازار وجود دارد. در بلند مدت انتقال قیمت بصورت کامل انجام می شود ولی در کوتاه مدت تعدیل قیمت بین دو سطح بازار نامتقارن است. به عبارت دیگر خرده فروشان از هر شوکی که شرایط عرضه و تقاضا را تحت تاثیر قرار می دهد منتفع می شوند

کلمات کلیدی: رابطه بلند مدت ، شیر ، مدل مارکف سوئیچینگ ، ایران