

عنوان مقاله:

بررسی حباب قیمت سکه با استفاده از تورش اعداد رند در اقتصاد رفتاری

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد باثبات، دوره 5، شماره 2 (سال: 1403)

تعداد صفحات اصل مقاله: 20

نویسندگان:

علی محمودی - دانشجوی دکتری گروه اقتصاد دانشکده علوم اداری و اقتصاد دانشگاه اصفهان

سعید صمدی - دانشیار، گروه اقتصاد، دانشکده علوم اداری و اقتصاد، دانشگاه اصفهان، ایران

لیلا ترکی - استادیار گروه اقتصاد دانشکده علوم اداری و اقتصاد دانشگاه اصفهان اصفهان ایران

سعید فتحی - گروه مدیریت، دانشکده علوم اداری و اقتصاد، دانشگاه اصفهان، اصفهان، ایران

خلاصه مقاله:

در این پژوهش سعی شده است تاثیر عوامل روانشناختی در بازار بر نوسانات قیمت سکه مورد بررسی قرار بگیرد. عوامل روانشناختی در دسته عواملی هستند که به وجود آمدن زیر شاخه اقتصاد رفتاری منتج شده است. از طرفی دیگر نوسانات قیمت ها در نزدیکی بعضی از اعداد خاص مانند اعداد رند نمونه رد کارایی بازار است که پایه و سنگ بنای تئوری های اقتصاد کلاسیک است. دوره مورد بررسی این پژوهش از سال ۱۳۹۲ تا ۱۴۰۰ می باشد. برای بررسی نحوه پراکندگی داده های قیمت سکه از آزمون ریچاردسون و اسمیت استفاده شده است. با استفاده از رویکرد گارچ (GARCH) معادله مقابل تخمین زده خواهد شد در اینجا یک دوره ۱۰ روزه در نظر گرفته می شود. چهار بازه زمانی در اطراف موانع مورد بررسی قرار گرفته است. برای بررسی دقیقتر فرضیه ها و همچنین بررسی نحوه توزیع فراوانی قیمت ها در اطراف اعداد رند از روش آماری نیکویی برآزش استفاده می شود. نتایج پژوهش وجود پدیده تجمع قیمت برای سکه را در دوره ۱۳۹۶-۱۴۰۰ تایید می کند. نتایج نشان می دهد که پراکندگی اعداد در قیمت ها یکسان نبوده و قیمت ها نسبت به اعداد رند واکنش نشان می دهند. از طرفی دیگر وجود این پدیده روانشناختی باعث بوجود آمدن حباب سکه یا فاصله گرفتن قیمت سکه از قیمت معادل ۱۰ گرم طلا است که به عنوان ارزش واقعی و ذاتی سکه در نظر گرفته می شود. در شرایط صعودی بازار حباب سکه بیشتر و معنادارتر بوده ولی در شرایط نزولی و ثبات بازار این حباب کاهش پیدا کرده است.

کلمات کلیدی:

واژه های کلیدی: اقتصاد رفتاری، تجمع قیمت، حباب سکه

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/2020489>

