

## عنوان مقاله:

تحلیل حباب های عقلایی در بازار ارز ایران با استفاده از آزمون دیکی فولر تعمیم یافته پیاپی

## محل انتشار:

اولین کنفرانس ملی توسعه پایدار در علوم انسانی و مطالعات فرهنگی ایران (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 12

## نویسندگان:

جلیل توتونچی - دانشگاه آزاد اسلامی، گروه اقتصاد، یزد، ایران، استادیار

الیاس محمدعلی پورشمیانی - دانشگاه آزاد اسلامی، گروه اقتصاد، یزد، ایران، (دانشجوی کارشناسی ارشد اقتصاد)

## خلاصه مقاله:

با توجه به اهمیت موضوع این مطالعه در صدد تحلیل حبابهای عقلایی در بازار ارز ایران با استفاده از آزمون دیکی فولر تعمیم یافته پیاپی در بازه زمانی 1360-1395 پرداخته است. نتایج حاکی از آن است که نتایج آزمون SADF و GSADF بیانگر وجود حباب های چندگانه در سری زمانی نرخ ارز در دوره های مختلف (1365)، 1372، 1379، (1390) را نشان می دهد. نتایج این آزمون بیانگر وجود حباب های چندگانه در سری زمانی نرخ ارز در دوره های مختلف است. بروز این حبابها در دوره های مختلف میتواند دلایلی گوناگونی داشته است. به طور نمونه سیاست های یکسان سازی نرخ ارز و تعدیل اقتصادی در اوایل دهه 1370، سیاست یکسان سازی نرخ ارز در اوایل دهه 1380 و یا شرایط خاص اقتصادی در اواخر دهه 1380 از جمله دلایل بروز این شرایط میتوانند باشد.

## کلمات کلیدی:

حباب عقلایی، بازار ارز، ایران، آزمون دیکی فولر پی در پیاپی

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/798411>

