

## عنوان مقاله:

کاربرد آزمون ریشه واحد غیرخطی مارکوف- سوییچینگ در بررسی نظریه برابری قدرت خرید

## محل انتشار:

فصلنامه نظریه های کاربردی اقتصاد، دوره 5، شماره 2 (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 26

## نویسندگان:

علی رضازاده - استادیار اقتصاد دانشگاه ارومیه

سیاوش محمدپور - دانشجوی دکتری اقتصاد موسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه ریزی،

فهمیده فتاحی - دانش آموخته کارشناسی ارشد اقتصاد دانشگاه ارومیه،

## خلاصه مقاله:

هدف این مطالعه بررسی اعتبار نظریه برابری قدرت خرید (PPP) در ایران با استفاده از داده های سالانه طی دوره زمانی 1339 تا 1396 می باشد. معمولا، از آزمون های ریشه واحد معمولی (مانند ADF) برای آزمون این نظریه استفاده می شود، ولی از آنجایی که در بازار ارز ایران چندین دوره ثبات و چندین دوره شوک شدید وجود دارد، به دلیل وجود چنین رفتار غیرخطی، نمی توان از آزمون های ریشه واحد خطی معمولی برای آزمون تیوری برابری قدرت خرید استفاده نمود. در این راستا، از آزمون ریشه واحد غیرخطی مارکوف سوییچینگ (MSADF) در کنار آزمون ریشه واحد خطی ADF برای بررسی نظریه برابری قدرت خرید استفاده گردید. نتایج آزمون ADF حاکی از عدم برقراری برابری قدرت خرید است؛ این در حالی است که آزمون MSADF اعتبار این تیوری را در برخی دوره ها در اقتصاد ایران مورد تایید قرار می دهد. نتیجه به دست آمده از آزمون غیرخطی، قابل انتظار به نظر می رسد، چرا که در اغلب سال ها طی دوره زمانی مورد مطالعه، بازار ارز تحت کنترل دولت قرار داشته است.

## کلمات کلیدی:

نرخ ارز، برابری قدرت خرید، ایران، آزمون ریشه واحد مارکوف- سوییچینگ

## لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/804179>

