

عنوان مقاله:

بررسی فراوانی-زمان سرریز نوسانات میان نرخ ارز، تورم، قیمت سهام و قیمت مسکن در ایران

محل انتشار:

فصلنامه اقتصاد و الگو سازی (اقتصاد سابق)، دوره 13، شماره 2 (سال: 1401)

تعداد صفحات اصل مقاله: 29

نویسندگان:

سهیل رودری - استادیار گروه اقتصاد دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه قم، قم ایران

سعید فراهانی فرد - استاد گروه اقتصاد دانشکده علوم اقتصادی و اداری دانشگاه قم، قم، ایران

ابوالفضل شاه آبادی - استاد گروه اقتصاد دانشکده علوم اجتماعی و اقتصادی دانشگاه الزهراء، تهران، ایران

امیدعلی عادلی - دانشیار گروه اقتصاد دانشکده علوم اقتصادی و اداری دانشگاه قم، قم، ایران

خلاصه مقاله:

در پژوهش حاضر نحوه انتقال و دریافت و همچنین رابطه علی انتقال نوسانات با توجه به دوره زمانی بروز نوسانات میان نرخ ارز، تورم، قیمت مسکن و بازار سهام در دوره زمانی ۱۳۸۵:۰۱-۱۴۰۱:۰۷ با تواتر ماهانه با استفاده از الگوی خودرگرسیون برداری با پارامترهای متغیر در زمان- مقیاس بررسی است. نتایج نشان می دهد که عمده ارتباط میان نوسانات متغیرهای مورد بررسی به صورت کوتاه مدت بوده است. چنانچه نوسانات کوتاه مدت ارز ادامه دار باشد و منجر به ایجاد نوسانات تورم و قیمت مسکن شود، در میان مدت نوسانات تورم و قیمت مسکن زمینه انتقال نوسان به نرخ ارز را ایجاد خواهد کرد و با افزایش نوسانات ارزی، بازار سهام بشدت متلاطم خواهد شد. بنابراین کنترل نوسانات ارز در کوتاه مدت مانع از افزایش نوسانات تورم و قیمت مسکن خواهد شد و چنانچه سیاست گذار این مهم را مدنظر قرار ندهد در میان مدت مجددا نرخ ارز از کانال تورم و قیمت مسکن متلاطم خواهد شد و متعاقبا نوسانات با شدت بیشتری به بازار سهام منتقل خواهد شد.

کلمات کلیدی:

نرخ ارز، تورم، قیمت سهام، قیمت مسکن، الگوی TVP-VAR-BK

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/1686759>

