

بررسی اثر نوسانات شاخص قیمت واردات بر سطح عمومی قیمت ها در دو بخش کالاهای

تجاری و غیرتجاری در ایران (۱۳۹۳-۱۳۷۵)

حمید خاوری^۱، مهدی بهنام^۲

۱- دانشجوی کارشناسی ارشد دانشگاه فردوسی مشهد

۲- عضو هیئت علمی گروه آموزشی اقتصاد دانشگاه فردوسی مشهد

چکیده

در این پژوهش برآنیم تا به توضیح جهت و میزان اثرگذاری متقابل هریک از متغیرهای شاخص قیمت واردات، قیمت برگ چای درجه یک و شاخص قیمت مسکن به عنوان نماینده دو بخش کالاهای تجاری و غیرتجاری با استفاده از یک الگوی خودتوضیح برداری دارای جزء با نوسان (VARGARCH)^۱ در جمهوری اسلامی ایران و طی دوره سالهای (۱۳۹۳-۱۳۷۵) پردازیم. نتایج حاصل از برآورد نهایی مدل فرضیه تاثیرپذیری شاخص قیمت مسکن از نوسانات نرخ ارز را به اثبات می رساند. هرچند رابطه بین دو متغیر یکسویه^۲ است. با توجه به دستاوردهای پژوهش همچنین یک رابطه علیت دوسویه^۳ بین نوسانات نرخ ارز و قیمت چای برقرار می باشد. و از آنجائیکه این کالا قابل مبادله با خارج می باشد شدت و مدت اثرگذاری نوسانات نرخ ارز بر آن بیشتر می باشد.

واژگان کلیدی: تورم، قیمت مسکن، قیمت کالاهای کشاورزی، بیماری هلندی، طبقه بندی JEL

۲۱, R۵, N۳۱E

^۱ Vector auto regression method^۲ unidirectional^۳ bidirectional