

Назар Дахмардех, Реза Кхаки, Марзійех Есфандіарі

Аналіз впливу новин на коливання цін на нерухомість

Основною метою статті є оцінка впливу новин на коливання цін на нерухомість в Ірані за допомогою симетричних та асиметричних моделей GARCH, T-ARCH, EGARCH та APGARCH на основі річних даних за період з 1971 до 2013 рр. Результати емпіричного дослідження підтверджують асиметричний та управлінський вплив новин на ринку нерухомості в Ірані. Також наслідки економічних потрясінь вказують на більший вплив поганих новин на коливання цін на нерухомість в порівнянні з гарними новинами.

Ключові слова: коливання цін на нерухомість, новини, модель GARCH, модель T-ARCH, модель EGARCH, модель APGARCH, Іран.

Класифікація JEL: C49, D89, E30, R31.



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution-NonCommercial 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/), що дозволяє повторне використання, розповсюдження та відтворення, забороняє використання матеріалів у комерційних цілях та вимагає наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.

Назар Дахмардех, Реза Кхаки, Марзійех Эсфандиари

Анализ влияния новостей на колебания цен на недвижимость

Основной целью статьи является оценка влияния новостей на колебания цен на недвижимость в Иране при помощи симметричных и асимметричных моделей GARCH, T-ARCH, EGARCH и APGARCH на основе годовых данных за период с 1971 по 2013 гг. Результаты эмпирического исследования подтверждают асимметричное и управленческое влияние новостей на рынке недвижимости в Иране. Также последствия экономических потрясений указывают на большее влияние плохих новостей на колебания цен на недвижимость по сравнению с хорошими новостями.

Ключевые слова: колебания цен на недвижимость, новости, модель GARCH, модель T-ARCH, модель EGARCH, модель APGARCH, Иран.

Классификация JEL: C49, D89, E30, R31.



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution-NonCommercial 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/), что позволяет повторное использование, распространение и воспроизведение, запрещает использование материалов в коммерческих целях и требует присутствия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи.