



**III Студенческая Универсиада по эконометрике**  
**МГУ имени М. В. Ломоносова**  
19 апреля 2014, Москва

**Задание 2-го тура**

Вы располагаете ежемесячными данными по ряду ключевых макроэкономических показателей США, в том числе по инфляции и динамике безработицы.

Требуется оценить кривую Филлипса для экономики США.

Для достижения этой цели вам рекомендуется ответить на следующие вопросы:

1. Каковы ваши первоначальные предположения о спецификации кривой Филлипса? Какие содержательные предпосылки лежат в основе этих предположений?
2. Существует ли взаимосвязь между безработицей и инфляцией в **долгосрочном** периоде? Как именно она устроена?
3. Существует ли взаимосвязь между безработицей и инфляцией в **краткосрочном** периоде? Как именно она устроена?
4. В соответствии с оцененной вами кривой Филлипса, каков ваш прогноз инфляции в США в апреле 2014 года?

В процессе подготовки ответов на вопросы не забудьте обосновать предлагаемый вами состав объясняющих переменных модели, период оценивания (если вы используете не все доступные данные) и используемый метод оценивания параметров модели. В частности, при выборе способа оценивания параметров модели не забудьте предварительно проанализировать стохастическую природу остатков.

**Кодировка переменных**

CPIAUCSL	Consumer Price Index for All Urban Consumers: All Items, Index 1982-84=100, Monthly, Seasonally Adjusted
UNRATE	Civilian Unemployment Rate, Percent, Monthly, Seasonally Adjusted
M1SL	M1 Money Stock, Billions of Dollars, Monthly, Seasonally Adjusted
INDPRO	Industrial Production Index, Index 2007=100, Monthly, Seasonally Adjusted
TB3MS	3-Month Treasury Bill: Secondary Market Rate, Percent, Monthly, Not Seasonally Adjusted

Удачи!