

IV Международная универсиада по эконометрике
МГУ им. М.В. Ломоносова
25 апреля 2015, Москва

Задание II тура

«Голландская болезнь», изначально связанная с негативными изменениями в структуре экономики, последовавшими за разработкой крупных месторождений природных ресурсов в ряде стран, по мнению многих экспертов, наблюдается и в России. Вы располагаете поквартальными данными за период 1995.1-2013.4 по ряду ключевых макроэкономических показателей России, в том числе по ВВП, промышленному производству, динамике внешней торговли.

Требуется для рассматриваемого периода проверить гипотезу о подверженности экономики России «голландской болезни».

Для достижения этой цели рекомендуется ответить на следующие вопросы:

1. Каковы Ваши первоначальные представления о факторах, предопределяющих «голландскую болезнь» в экономике России
2. Существует ли взаимосвязь между динамикой цен на нефть и обменным курсом рубля в долгосрочном периоде? Как именно она устроена?
3. Какие факторы могут повлиять на характер этой взаимосвязи в краткосрочном периоде?
4. Каков характер взаимосвязи структуры российского экспорта с динамикой реального курса рубля? (Указание: проанализируйте динамику основных показателей структуры экспорта на фоне динамики реального курса рубля)
5. Одним из значимых проявлений «голландской болезни» является опережающее развитие сектора производства товаров и услуг конечного потребления в сравнении с динамикой промышленного производства. Подтверждается ли этот вывод на примере экономики России? Обоснуйте его с использованием эконометрических методов (Указание: проанализируйте динамику показателя отношения базового индекса производства в промышленности и базового индекса оборота розничной торговли к базовому индексу реального ВВП России). Применим ли стандартный регрессионный анализ для построения этих эконометрических моделей?

В процессе подготовки ответов на вопросы не забудьте содержательно обосновать используемую модель экономического явления. При разработке спецификации исследуемой зависимости рекомендуется использовать всю имеющуюся информацию о факторах, влияющих на динамику анализируемых показателей. При эконометрическом оценивании отметьте следующие немаловажные аспекты:

1. Характер стационарности (нестационарности) рядов наблюдений
2. Характер эконометрических методов, которые используются при оценивании параметров модели
3. Что можно сказать о дамми-переменных, включаемых в модель?
→Присутствуют ли в модели резко отклоняющиеся наблюдения?

Ind	Индекс реального объема промышленного производства в России, без поправки на сезонность, квартальный, в базовом выражении
Retail	Индекс реального оборота розничной торговли в России, без поправки на сезонность, квартальный, в базовом выражении
Export	Совокупный объем экспорта России, млрд. долл. США, квартальный
Import	Совокупный объем импорта России, млрд. долл. США, квартальный
Inv	Индекс реальных инвестиций в основной капитал в России, без поправки на сезонность, квартальный, в базовом выражении
Unemp	Количество безработных в России, млн. чел., квартальный
Wage	Средняя номинальная заработная плата на одного работника в России, руб. в месяц, квартальный
Income	Среднедушевой денежный доход в России, руб. в месяц, квартальный
M2	Денежный агрегат M2 в России, млрд. руб. квартальный
E	Номинальный обменный курс доллара США в России, руб./долл., квартальный
Incons	Доходы консолидированного бюджета России, млрд. рубл., квартальный
Infed	Доходы федерального бюджета России, млрд. рубл., квартальный
CPI	Индекс потребительских цен в России, в % на конец периода к концу предыдущего периода, квартальный
Eur	Номинальный обменный курс евро в России, руб./евро, квартальный
Woil	Экспортная цена на российскую нефть, т. долл. США за 1 тонну
GDP	Индекс реального ВВП России, без поправки на сезонность, квартальный, в базовом выражении
rer	Реальный эффективный обменный курс рубля, квартальный, в базовом выражении
total_export_cbr	Совокупный объем экспорта России по данным платежного баланса, млн. долл. США, квартальный
export_crude_oil_cbr	Объем экспорта сырой нефти из России по данным платежного баланса, млн. долл. США, квартальный
export_oil_products_cbr	Объем экспорта нефтепродуктов из России по данным платежного баланса, млн. долл. США, квартальный
export_natural_gas_cbr	Объем экспорта природного газа из России по данным платежного баланса, млн. долл. США, квартальный
other_export_cbr	Объем экспорта прочих товаров из России по данным платежного баланса, млн. долл. США, квартальный