



Задание 2-го тура

Вы располагаете квартальными данными (за период 4-й квартал 1994 г. — 3-й квартал 2011 г.) по ключевым макроэкономическим показателям социально-экономического развития России, среди которых ВВП, индекс потребительских цен (ИПЦ), доход, конечное потребление, экспорт и импорт отнесены к эндогенным переменным, а остальные — к экзогенным.

Требуется построить структурную динамическую регрессионную модель, описывающую поведение **конечного потребления** (CO) в зависимости от выбранных вами объясняющих переменных, в состав которых вы можете включать экзогенные и лагированные эндогенные показатели.

Рекомендуется:

1. *Обосновать формирование состава объясняющих переменных модели.*
2. *При выборе способа оценивания параметров модели учесть (предварительно проанализировав) стохастическую природу остатков.*
3. *Учесть в структуре модели кризисы 1998-го и 2008 гг. и возможную сезонность отдельных переменных.*
4. *Дать экономически содержательный анализ результатов оценивания модели.*

Кодировка переменных

Экзогенные переменные

I - инвестиции (млрд руб.)

O - цена на нефть (долл. США за барель)

E - курс доллара США (руб. за 1 долл. США)

GT - государственные социальные расходы (млрд руб.)

TR - средневзвешенные тарифы на экспорт (млрд руб.)

Эндогенные переменные

Y – валовый внутренний продукт (млрд руб.)

X - экспорт товаров (млрд руб.)

P - индекс потребительских цен (% к предыдущему кварталу)

N - совокупные доходы населения (млрд руб.)

M - импорт товаров (млрд руб.)

CO - конечное потребление