

И. В. Треруб

ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЕ ИССЛЕДОВАНИЯ. ПРАКТИЧЕСКИЕ ПРИМЕРЫ

ECONOMETRIC STUDIES. PRACTICAL EXAMPLES



www.e.lanbook.com



**ЭБС
 ЛАНЬ**



И. В. ТРЕГУБ

**ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЕ
ИССЛЕДОВАНИЯ
ПРАКТИЧЕСКИЕ ПРИМЕРЫ**

**ECONOMETRIC
STUDIES
PRACTICAL EXAMPLES**

МОНОГРАФИЯ



САНКТ-ПЕТЕРБУРГ • МОСКВА • КРАСНОДАР
2018

ББК 65в6я723

Т 66

Трегуб И. В.

Т 66 Эконометрические исследования. Практические примеры. *Econometric studies. Practical Examples*: Монография. — СПб.: Издательство «Лань», 2018. — 164 с. — (Учебники для вузов. Специальная литература).

ISBN 978-5-8114-3196-0

В монографии представлены современные практические примеры построения эконометрических моделей реальных экономических систем, которые будут полезны студентам при самостоятельном написании курсовых работ и домашних творческих работ по дисциплине «Эконометрика». Приводится подробное описание всех этапов построения моделей, необходимое для понимания причинно-следственных связей в экономике для планирования, прогнозирования и принятия решений. Модели реализованы на персональных компьютерах в пакете прикладных программ Microsoft Office Excel и EViews.

Предназначена для студентов, обучающихся по направлению «Экономика» по программе «Международные финансы на английском языке».

ББК 65в6я723

Рецензенты:

С. В. АРЖЕНОВСКИЙ — доктор экономических наук, профессор кафедры статистики, эконометрики и оценки рисков Ростовского государственного экономического университета;

В. И. ТИНЯКОВА — доктор экономических наук, профессор кафедры информатики и прикладной математики Российского государственного социального университета.

Обложка

Е. А. ВЛАСОВА

© Издательство «Лань», 2018

© И. В. Трегуб, 2018

© Издательство «Лань»,
художественное оформление, 2018

Content

INTRODUCTION.....	4
1. THEORY OF ECONOMETRIC STUDIES	6
1.1. Econometric Modeling.....	6
1.2. Instruments of the Model Testing.....	15
2. ECONOMETRIC MODELS OF FINANCIAL MARKET	20
2.1. S&P 500 Stock Index Arbitrage Pricing Model.....	20
2.2. VTB Share Price Model.....	37
2.3. Risk Analysis of Financial Investments in the Russian Stock Market.....	44
3. THE MACROECONOMETRIC MODELS.....	56
3.1. Singapore Macroeconometric Model.....	56
3.2. Econometric Analysis of Monetary Policy Influence on Macroeconomic Aggregates of National Economy	77
3.3. Malaysia Macroeconometric Model	88
3.4. Econometric Analysis of Influence of the USA Monetary Policy on the National Economy.....	105
3.5. Exchange rate of the Russian Ruble in the Framework of EAEU	115
4. THE ECONOMETRIC MODELS OF INDUSTRIAL MARKETS	125
4.1. Average Price Model of Real Estate in Moscow Region.....	125
4.2. Model of Audi Cars Sell Volume.....	142
CONCLUSION	157
Appendix.....	160
REFERENCES.....	158