

## Секция «Инновационная экономика и эконометрика»

### Модель российской экономики в форме системы одновременных уравнений *Зубков Владимир Валерьевич*

*Аспирант*

*Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова, Московская  
школа экономики (факультет), Москва, Россия*

*E-mail: msczvv2009@yandex.ru*

Сегодня мы можем отметить повышенный интерес политиков к применению эконометрических и других моделей для принятия решений. Центральные банки развитых стран, а также ряда развивающихся, берут на вооружение сложные модели, сочетающие в себя как теоретический подход, в первую очередь в рамках неокейнсианской парадигмы, а также современные методы моделирования, как например модели DSGE. Магистральным направлением данного течения стал подход новой открытой экономики.

Тем не менее, не упускаются из виду и более традиционные методы моделирования макроэкономики. Это модели, построенные с помощью векторных авторегрессий и моделей коррекции ошибок, а также системы одновременных уравнений.

Объектом исследования выступает внешний сектор российской экономики, который играет важную роль в развитии страны не только в качестве связующего звена с остальным миром, но и как источник доходов и поставщик технологий и инноваций. При этом исследуются потоки товаров и услуг, капитала, динамика валютных курсов, официальных резервов, ставок процента и др.

Предметом исследования является взаимодействие этих макроэкономических показателей не только между собой, но также и с другими показателями, непосредственно не входящими во внешний сектор российской экономики, как-то: ВВП, бюджетные расходы, валовое накопление и т.д.

Целью данного исследования выступает определение основных взаимосвязей макроэкономических показателей внешнего сектора российской экономики и факторов, влияющих на них, а также их взаимодействие с экзогенными показателями.

К задачам исследования относятся поиск и отбор необходимых для выполнения целей исследования данных по внешнему сектору российской экономики, а также приведение данных к сопоставимому виду. Кроме того, ставится задачей моделирование нескольких конкурентных моделей с тем, чтобы выбрать наилучшую. На основе результатов, полученных с помощью данной модели, исследовать выявленные закономерности и сравнить их с теоретическими концепциями открытой макроэкономики.

В качестве метода моделирования внешнего сектора российской экономики в данном исследовании был выбран метод систем одновременных уравнений, позволяющий оценивать несколько уравнений одновременно, задавая экзогенные и эндогенные переменные. Метод для моделирования экономики был впервые применен Клейном[1] для построения модели экономики США в 1920-е – 1940-е гг. Из отечественных работ можно выделить работу по российской экономике, выполненную сотрудниками ЦЭМИ РАН - Макаров В.Л., Айвазян С.А., Борисова С.В., Лакалин Э.А.[2].

Результаты данного исследования могут быть использованы для построения краткосрочных прогнозов и сценарного анализа, применимы для работы Министерства эко-

номического развития РФ с целью получения прогнозов показателей внешнего сектора, а также принятия решения относительно проводимой политики.

[1] Klein L.. Economic Fluctuations in the United States 1921-1941 //New York, Wiley. - 1950

[2] Макаров В.Л., Айвазян С.А., Борисова С.В., Лакалин Э.А. Эконометрическая модель экономики России для целей краткосрочного прогноза и сценарного анализа. / Препринт # WP/2001/121. - М.: ЦЭМИ РАН, 2001. - 34 с.

### **Литература**

1. Gavrilentov, E. A quarterly model of the Russian economy: estimating the effects of a devaluation //Centre for economic forecasting London Business School. – 1999;
2. Klein L.. Economic Fluctuations in the United States 1921-1941 //New York, Wiley. - 1950;
3. Obstfeld, Maurice. International Macroeconomics: Beyond the Mundell-Fleming Model //International Monetary Fund Staff Papers. Special Issue. – 2001;
4. Айвазян, С.А., Бродский, Б.Е.. Макроэкономическое моделирование: подходы, проблемы, пример эконометрической модели российской экономики //Прикладная эконометрика №2. – 2006;
5. Макаров В.Л., Айвазян С.А., Борисова С.В., Лакалин Э.А. Эконометрическая модель экономики России для целей краткосрочного прогноза и сценарного анализа. / Препринт # WP/2001/121. - М.: ЦЭМИ РАН, 2001;
6. <http://www.gks.ru/> (Федеральная служба государственной статистики России);
7. <http://www.cbr.ru> (Центральный банк РФ).