

Моделирование влияния энергетических шоков на основные макроэкономические показатели.

Цель: оценить характер влияния энергетических шоков на динамику макроэкономических показателей.

Задачи:

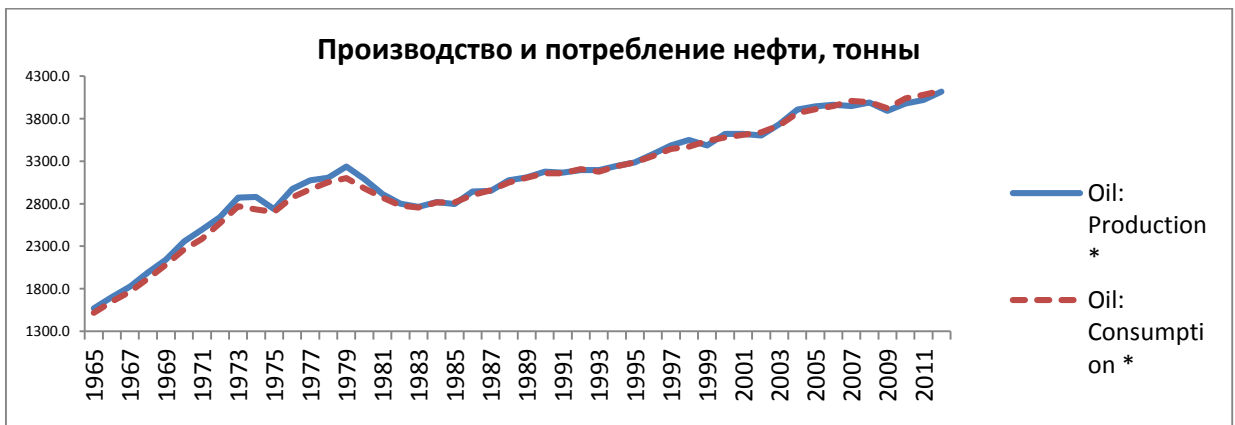
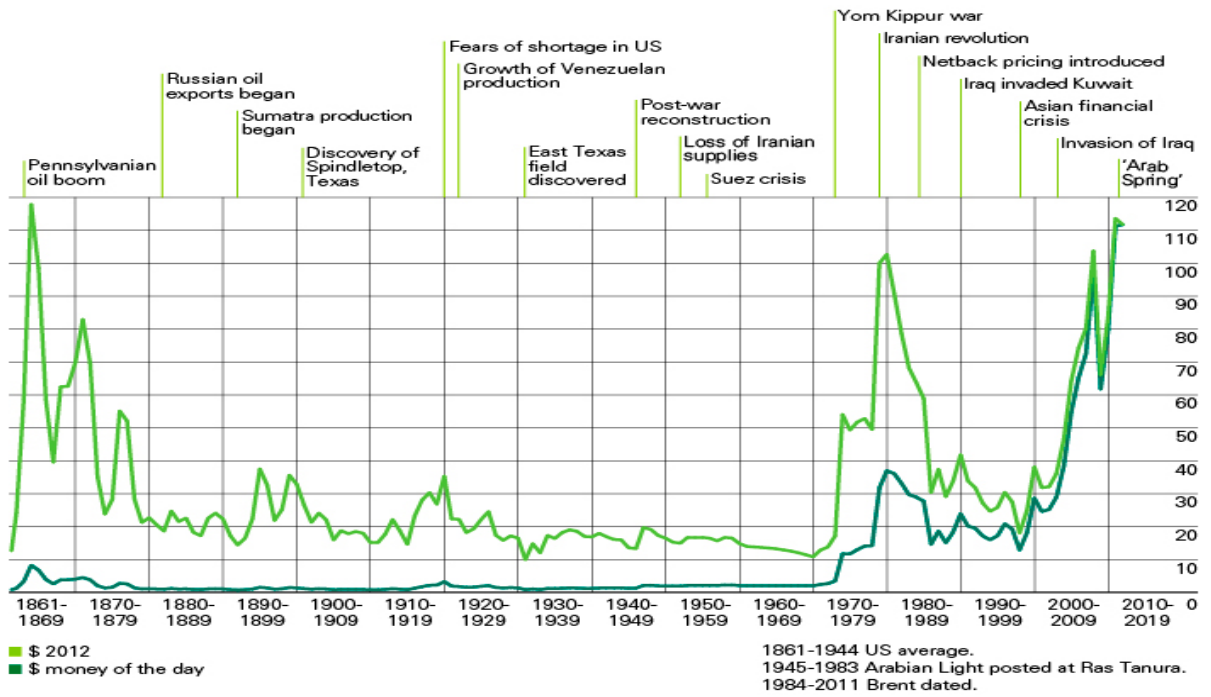
- Сбор данных
- Эконометрическая оценка влияния энергетических шоков (в основном, нефтяных) шоков на макроэкономические показатели (ВВП, безработицу, инфляцию и тд)
- Анализ влияния нефтяных шоков на экономику стран G20 + стран ОПЕК

1. Австралия 2. Аргентина 3. Бразилия 4. Великобритания 5. Германия 6. Европейский союз 7. Индия 8. Индонезия 9. Италия 10. Канада 11. КНР 12. Мексика 13. Россия 14. Саудовская Аравия 15. США 16. Турция 17. Франция 18. Республика Корея 19. ЮАР 20. Япония

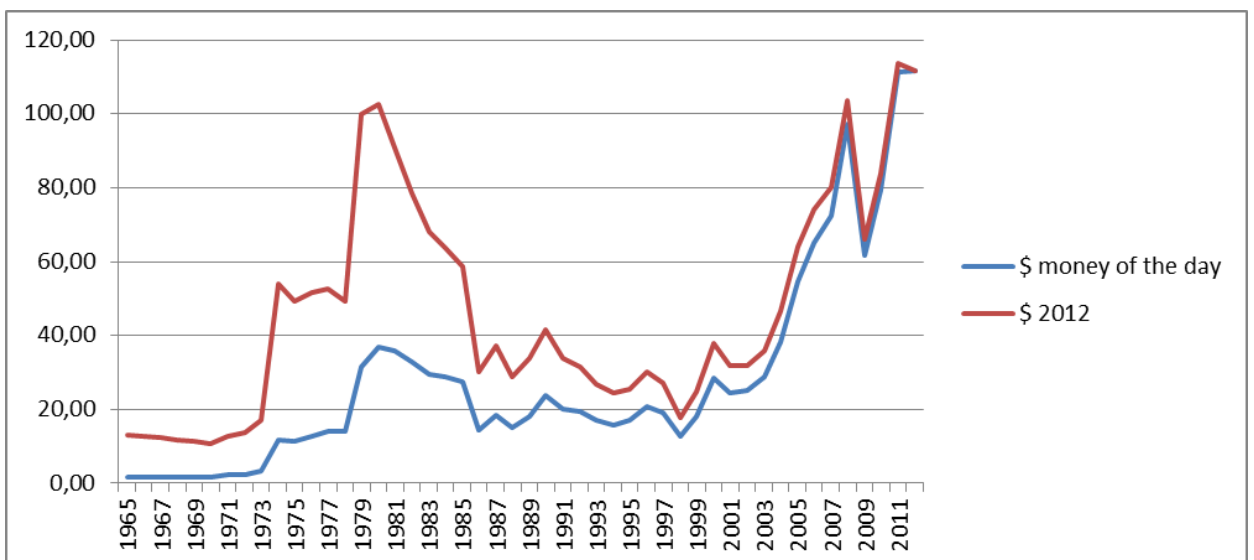
ОПЕК: Иран, Ирак, Кувейт, Саудовская Аравия, Венесуэла, Катар, Ливия, Объединённые Арабские Эмираты, Алжир, Нигерия, Эквадор и Ангола

Этапы работы:

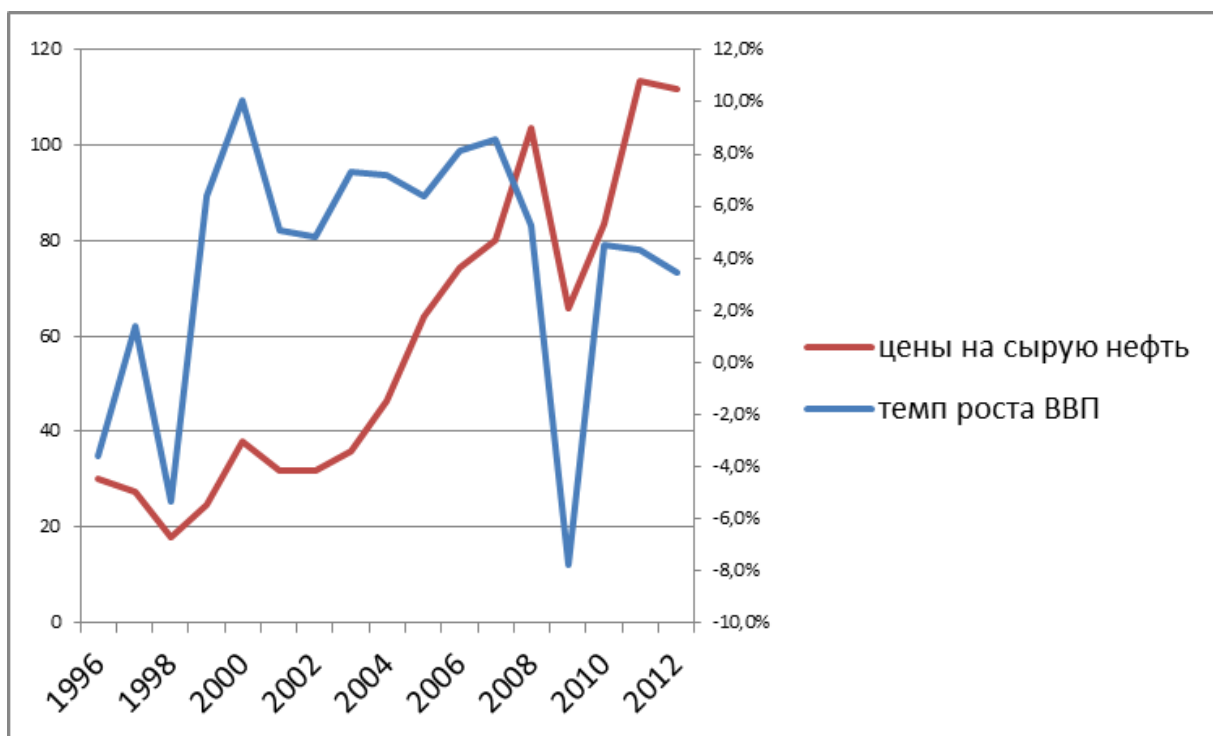
- выявить нефтяные шоки (шоки спроса или предложения)
- для каждой страны собрать данные по реальному ВВП и его темпу роста, потреблению, безработице, инфляции, доле экспорта/импорта энергоресурсов во всем экспорте/импорте и ВВП, доле энергоемкой промышленности в ВВП, объему иностранных инвестиций в экономику
- на основании эмпирических исследований построить несколько видов шоков
- для каждой страны провести тест Грейнджера на связь макропоказателей и нефтяных шоков



Динамика цен на сырую нефть



Россия: видна связь между ценами на нефть и темпом роста ВВП



Литература.

1. Р. М. Мельников, Влияние динамики цен на нефть на макроэкономические показатели российской экономики//Прикладная эконометрика, № 1(17) 2010
2. Alessandro Cologni, Matteo Manera, The asymmetric effects of oil shocks on output growth: a Markov-switching analysis for the G-7 countries// Economic Modelling 26 (2009), 2009
3. Fang-Yu Yeh, Jin-Li Hu, Cheng-Hsun Lin , Asymmetric impacts of international energy shocks on macroeconomic activities// *Energy Policy*, Volume 44, May 2012, Pages 10-22
4. Elizaveta Archanskaia, Jerome Creel, Paul Hubert, The nature of oil shocks and the global economy//*Energy Policy* 422 (2012), 2012
5. James D. Hamilton, A neoclassical model of unemployment and the business cycle, 1988
6. Limin Du, Yanan He, Chu Wei, The relationship between oil price shocks and China's macro-economy: an empirical analysis// *Energy Policy* 32 (2010), 2010
7. Leven Aydin, Mustafa Acar, Economic impact of oil price shocks on the Turkish economy in the coming decades: a dynamic CGE analysis// *Energy Policy* 39 (2011), 2011
8. Lutz Kilian, A comparison of the effects of exogenous oil supply shocks on output and inflation in the G7 countries//*Journal of the European Economic Association*, Vol.6, №1, 2008

9. Nader Naifar, Mohammed Saleh Al Dohaiman, Nonlinear analysis among crude oil prices, stock markets' return and macroeconomic variables// International Review of Economics and Finance, 2013
10. Panos Varangis, Sona Varma, Angelique dePlaa and Vikram Nehru, EXOGENOUS SHOCKS IN LOW INCOME COUNTRIES: ECONOMIC POLICY ISSUES AND THE ROLE OF THE INTERNATIONAL COMMUNITY// <http://siteresources.worldbank.org/INTDEBTDEPT/PolicyPapers/20747753/Varangis-Varma-dePlaa-Nehru.pdf>, November 20, 2004
11. Rebeca Jimenez-Rodriguez, The impact of oil price shocks: evidence from the industries of six OECD countries// Energy Economics 30 (2008), 2008
12. <http://www.bp.com/en/global/corporate/about-bp/statistical-review-of-world-energy-2013/review-by-energy-type/oil/oil-prices.html>
13. www.gks.ru