

Моделирование функции потребления: подход на основе микро-данных

Научный руководитель – Картаев Филипп Сергеевич

Куровский Глеб Станиславович

Студент (магистр)

Московский государственный университет имени М.В.Ломоносова, Экономический факультет, Кафедра математических методов анализа экономики, Москва, Россия

E-mail: gleb.kurovskiy@gmail.com

Введение

Задача оценки потребительской функции спроса Фридмена обсуждается в литературе достаточно давно. Впервые функцию потребления исследовал (Фридмен 1957). Функция потребления является важнейшей составляющей в кейнсианской теории, которая помогает количественно оценивать последствия денежно-кредитной и бюджетно-налоговой политики. Функция потребления помогает ответить на ряд вопросов, например, на сколько изменятся потребление и сбережение, если дополнительно перечислить населению трансферты. Еще одной прикладной областью потребительской функцией является использование ее для калибровки параметром моделей общего равновесия, например, уравнения Эйлера (ДеЖуан П. и др. 2006). Стоит отметить, что оценка предельной склонности к потреблению может быть гетерогенна по доходу населения (Карролл и др. 2017). В рамках данной работы планируется оценить предельную склонность к потреблению на основе микроэкономических данных RLMS-HSE по различным группам населения (в зависимости от дохода, возраста, наличия предпринимательской деятельности).

Используемые данные

- 1) Российский мониторинг экономического положения и здоровья населения НИУ-ВШЭ
- 2) У каждого домашнего хозяйства – своя история ID-номеров
- 3) Были отобраны данные об одних и тех же д/х за 7 лет с 2009 по 2014 годы (исключение кризисных периодов)
- 4) Таких домашних хозяйств: 2358
- 5) Итого наблюдений: 16506

Эмпирическая оценка

Помимо стандартной функции потребления произведен анализ динамических свойств модели Фридмена. Для этого проведено преобразование Койка (Халл Р. 1978) в результате чего функция потребления преобразуется к следующему виду: $C_t = \beta\lambda Y_t + (1 - \lambda)C_{t-1} + C_t^T - (1 - \lambda) * C_{t-1}^T$ Где C_t – потребление в период t, C_t^T – переменное потребление в период t, Y_t – доход в период t. Такая спецификация позволяет разделить краткосрочную и долгосрочную предельную склонность к потреблению. Параметр β отвечает за долгосрочное значение MPC, параметр $\beta\lambda$ – краткосрочное.

Источники и литература

- 1) Carroll C. et al. The distribution of wealth and the marginal propensity to consume //Quantitative Economics. – 2017. – Т. 8. – №. 3. – С. 977-1020
- 2) DeJuan J. P., Seater J. J., Wirjanto T. S. Testing the permanent-income hypothesis: new evidence from West-German states (Länder) //Empirical Economics. – 2006. – Т. 31. – №. 3. – С. 613-629

- 3) Friedman M. et al. A Theory of the Consumption Function //NBER Books. – 1957
- 4) Hall R. E. Stochastic implications of the life cycle-permanent income hypothesis: theory and evidence //Journal of political economy. – 1978. – Т. 86. – №. 6. – С. 971-987