

Опережающий индикатор в банковском секторе

Акимов Никита Викторович

III курс бакалавриата

*Московский государственный университет имени М.В.Ломоносова,
экономический факультет, Москва, Россия*

E-mail: akimovnv@yandex.ru

В современной России банковский сектор занимает определяющую позицию в развитии финансового сектора, а соответственно, и экономики в целом. На сегодняшний момент есть основания полагать, что в дальнейшем этот рынок будет активно развиваться и являться потенциальным полем для извлечения прибыли. Важным фактором анализа инвестиционной привлекательности того или иного сегмента рынка, а также отдельных его частей, является изучение динамики его ценового индекса. Для банковского сектора таковым является Индекс ММВБ Финансы (MICEX FNL).

Целью настоящего исследования является построение опережающего композитного индикатора (CLI) для банковской сферы с последующим формированием (на основе полученных результатов) инвестиционного портфеля. Для ее достижения были решены необходимые задачи: отбор факторов, оказывающих наиболее значимое влияние на индекс MICEX FNL, и выбор подходящей для данного сектора модели построения CLI.

Литература

1. Marcellino, M. (2006) «Leading Indicators», IEP-Bocconi University, IGIER and CEPR.
2. Marcellino, M., Carriero A. (2007), “A comparison of methods for the construction of composite coincident and leading indexes for the UK”, Queen Mary, University of London, UK; IEP-Bocconi University, IGIER and CEPR, Italy
3. Yu T. Yamada Y., Freeman J., Ellerton C., “Global Banking Sector – Credit Quality in a Deleveraging World”, September 2011, Deutsche Bank Global Market Research
4. Крук Д., Коршун А. (2010), «Экономический цикл и опережающие индикаторы: методологические подходы и возможности использования в Беларуси», Исследовательский центр ИПМ
5. Смаилов А., (2011) «Методика построения сводного опережающего индикатора», Приложение к приказу Председателя Агентства Республики Казахстан по статистике от «7» сентября 2011 г. № 251
6. <http://cbr.ru/>