

Таблица 4 - Изменение дневных доходностей при включении ценной бумаги в Ломбардный список.

Без винзоризации:

Временной интервал	1 день	2 дня	3 дня
Включены в течение 3 недель	0,566 (0,260)	-0,092 (0,856)	0,198 (0,748)
Включены после 3 недель	0,325 (0,124)	0,339 (0,247)	-0,029 (0,934)

*Примечание: временной интервал показывает, за какой временной промежуток после объявления были подсчитаны кумулятивные аномальные доходности, все значения коэффициентов – в процентах, в скобках указаны значения p-value, * - коэффициент значим на 10%-ом уровне значимости, ** - коэффициент значим на 5%-ом уровне значимости, *** - коэффициент значим на 1%-ом уровне значимости. Количество наблюдений – 13 608, $R^2 = 0,185$.*