

Вступительное слово

Современное университетское экономическое образование держится на трех китах: макроэкономике, микроэкономике и эконометрике. После снятия идеологических барьеров с экономического образования в России — доминирования марксистской политической экономии — наши вузовские экономические программы стали перестраиваться в указанном направлении. Свидетельств этого много, в частности, появилось много учебников, в основном переводных, по макро- и микроэкономике. А вот с эконометрикой получилась промашка. Ни переводных, ни отечественных учебников нет. И почти нет преподавателей, способных читать курс эконометрики. Так что с третьим китом экономического образования пока в России сложно.

Причины в общем-то понятны. В централизованной плановой экономике эконометрика была не нужна, в отличие, скажем, от балансовых или оптимизационных методов: межотраслевого баланса и линейного программирования, по которым и книги, и специалисты у нас имелись и имеются.

Учебное пособие, которое вы, читатель, держите в руках, первое такого рода на русском языке. Оно написано по современным западным стандартам и апробировано на практике, на российских студентах. Авторы — квалифицированные специалисты в области эконометрики. Я. Магнус в течение многих лет читает курсы эконометрики в Центре экономических исследований Тилбургского университета (Голландия) и Лондонской школе экономики. П. Катышев и А. Пересецкий — математики, которые впервые столкнулись с эконометрикой, будучи ассистентами профессора Я. Магнуса в Российской экономической школе. Одновременно они являются ассистентами профессора С. А. Айвазяна, который читает там же курс прикладной статистики. В настоящее время они читают курс лекций по эконометрике в РЭШ самостоятельно.

Почему эконометрика лежит в основе университетского экономического образования? Ответ на этот вопрос непросто. Надеюсь, читатель получит на него ответ, проработав книгу. Чем большим профессиона-

лом становится экономист, тем яснее он понимает, что в экономике все зависит от всего. Причинно-следственными связями занимается экономическая теория, а связями вообще, без выявления их причин, — эконометрика. Поскольку экономика относится к тем областям человеческой деятельности, где интуиция, искусство не менее важны, чем наука, эконометрика нужна всем экономистам, ибо она сама есть смесь искусства и науки.

В. Л. Макаров,
директор Центрального
экономико-математического института РАН,
ректор РЭШ, академик РАН

Экономисты используют количественные данные для наблюдения за ходом развития экономики, ее анализа и прогнозов. Набор статистических методов, используемых для этих целей, называется в совокупности *эконометрикой*. Для успешного применения этих методов требуется точное (или хотя бы приблизительно верное) моделирование поведения экономических агентов, необходимо также понимание процессов, породивших имеющиеся данные, и насколько эти данные отражают те явления, которые мы пытаемся исследовать. Поскольку наши модели неполны, а данные несовершенны, значительная часть эконометрики посвящена методам, которые могли бы работать с такими моделями и данными. В конце концов, эконометрика является не более чем набором инструментов, хотя и очень полезных. Качество ингредиентов (моделей и данных) и то, как мы их используем, определяют результаты нашего анализа. Но и хорошие инструменты анализа также необходимы. Эконометрика является одновременно нашим телескопом и нашим микроскопом для изучения окружающего экономического мира.

Книга, лежащая перед нами, является первым оригинальным учебником эконометрики, изданным на русском языке за последние десятилетия. Авторы преподавали этот материал пяти поколениям студентов Российской экономической школы и отработывали на них свои педагогические методики. Книга представляет собой прекрасное введение в основы эконометрики в том виде, в котором она преподается и используется во всем мире. Настало время для того, чтобы российские студенты и исследователи имели свой собственный учебник по основам

этой науки. Надеюсь, что издание этой книги является только началом, и в дальнейшем в России появятся как учебники, содержащие изложение дальнейших разделов эконометрики, так и высококачественные прикладные эконометрические работы, использующие методы, приведенные в данной книге.

Цви Грилихес,
профессор экономики имени Пола М. Варбурга
(Гарвардский Университет, Кембридж, США),
Президент Эконометрического общества (1975),
Президент Американской экономической ассоциации (1993)

Zvi Griliches,
Paul M. Warburg Professor of Economics,
Harvard University, Cambridge, USA,
President of Econometric Society (1975),
President of American Economic Association (1993)

От авторов

Цви Грилихес умер 4 ноября 1999 г. Будучи одним из выдающихся эконометристов нашего времени, он внес значительный вклад как в теорию, так и в приложения эконометрики. Цви стоял у истоков Российской экономической школы и до самого конца был активным и влиятельным членом Международного комитета советников РЭШ. Цви Грилихес сыграл существенную роль в развитии эконометрики в России и стал другом тех, кому выпало счастье работать с ним.