

Предисловие к шестому изданию

Первые пять изданий данной книги были выпущены общим тиражом 38 000 экз. В 2001 г. эконометрика была введена в стандарт экономического образования, и возникла острая потребность в учебниках по эконометрике на русском языке.

В связи с этим в последнее время появилось несколько учебников и учебных пособий по эконометрике разного уровня, ориентированных на студентов с различной математической подготовкой (см., например, Айвазян, 2002; Елисеева, 2001а,б; Бородич, 2001; Доугерти, 2001; Замков, 2001; Кремер, Путко, 2002). Наша книга содержит как достаточно строгое и полное изложение материала, удовлетворяющее студентов со склонностью к математике, так и значительное количество практических примеров и упражнений, предназначенных для тех студентов, которых больше интересуют прикладные аспекты корректного использования эконометрических методов, чем сама эконометрическая теория.

По сравнению с предыдущим изданием произошло некоторое изменение нумерации глав. Глава 7, посвященная доступному обобщенному методу наименьших квадратов, вставлена в качестве раздела 5.3 в главу 5, непосредственно после раздела, содержащего описание обобщенного метода наименьших квадратов. Соответственно, нумерация глав начиная с 8-й сдвинулась на единицу.

В связи с интенсивным расширением эконометрического образования в России изменяется понятие «начального курса эконометрики», все более приближаясь к современному состоянию эконометрики. В шестое издание книги добавлены три новые главы: 13-я «Панельные данные», 14-я «Предварительное тестирование» и 15-я «Эконометрика финансовых рынков».

Тема «Панельные данные» дополняет книгу до полного набора тем, необходимых для начального эконометрического образования. Эта тема особенно важна для экономических исследований в России, где временные ряды макроэкономических данных еще слишком короткие для применения методов анализа временных рядов.

Главы 14 и 15 (помечены *) не входят в стандартный набор тем, включаемых обычно в начальный курс эконометрики.

Материал главы 14 содержит введение в новую и интенсивно развивающуюся область эконометрики — теорию оценок, основанных на предварительном отборе моделей (*pretest-estimators*) и анализ чувствительности (*sensitivity analysis*), в которой активно работает один из авторов (Ян Магнус). Эта глава может использоваться в продвинутых курсах эконометрики для студентов с хорошей математической подготовкой, которые интересуются теоретическими и прикладными разделами эконометрики.

Глава 15 посвящена приложениям эконометрических методов к численному анализу финансовых рынков. На английском языке существует огромное количество литературы, посвященной теории и эконометрическому анализу финансовых рынков (см., например, Cochrane, 2001; Campbell, Lo, MacKinlay, 1997; LeRoy, Werner, 2001; Luenberger, 1998; Mills, 1999; Gouriéroux, 1997). Также издано несколько книг на русском языке, из которых можно отметить книгу (Малюгин, 2003). Данная глава может использоваться в продвинутых курсах эконометрики, ориентированных на студентов, интересующихся прикладным эконометрическим анализом финансовых рынков.

В шестое издание книги добавлены новые упражнения. Особенностью этого издания является наличие компьютерных упражнений, данные для которых доступны в Интернете по адресу <https://econometrics.nes.ru/mkp/>.

Благодарности

Мы благодарны профессорам Тилбургского университета Артуру ван Суэсту (Arthur van Soest), Тео Нейману (Theo Nijman) и Бертрану Меленбергу (Bertrand Melenberg) за их лекции на выездных семинарах по эконометрике и обсуждения материалов новых 14-й и 15-й глав книги. Мы благодарны Дмитрию Данилову (Tilburg University) за помощь в подготовке главы 14. Мы также благодарны профессорам Эрику Гисельсу (Eric Ghysels, University of North Carolina), Франсу де Рону (Frans DeRoos, Tilburg University), Юрию Кабанову (Université de Besançon) и Владимиру Малюгину (Белорусский государственный университет) за ценные обсуждения материала главы 15.

Мы искренне благодарим студентов Российской экономической школы, которые своим кропотливым трудом помогли выявить неточности и опечатки в первоначальном тексте.

Мы обязаны преподавателю РЭШ Сергею Голованю за помощь в подготовке данного издания. Сергей Головань также добавил новые упражнения и подготовил все компьютерные упражнения. Он является и одним из

авторов нового издания задачника по эконометрике с решениями задач из данного учебника.

Мы в огромном долгу перед Надеждой Викторовной Андриановой, которая кропотливо правила все издания нашей книги.

Мы благодарны Нидерландской организации научных исследований (NWO) за финансовую поддержку подготовки шестого издания нашей книги.

Наконец, мы считаем своим приятным долгом поблагодарить Центр экономических исследований Тилбургского университета (Нидерланды) за возможность стажировки и научных визитов, помощь в организации выездных семинаров по эконометрике для преподавателей вузов России и республик бывшего СССР, проведенных РЭШ в 1997–2002 гг., что в значительной степени способствовало появлению нового издания.

Тилбург/Москва, июнь 2003 г.