



СОВМЕСТНАЯ КОНФЕРЕНЦИЯ «Современный эконометрический инструментарий и его приложения» (META2020) и семинар «Прикладная эконометрика»

С 22 по 26 сентября 2020 года проходили совместные заседания Седьмой международной конференции «Современный эконометрический инструментарий и его приложения» (VII International Conference “Modern Econometric Tools and Applications”, META2020) и Второго семинара «Прикладная Эконометрика» (II Workshop “Applied Econometrics”). Ограничения, связанные с пандемией, объединили эти два ставших уже традиционными, мероприятия организуемые нижегородским и московским кампусами НИУ ВШЭ, и перенесли их на интернет-платформу ZOOM. Для участия в конференции зарегистрировалось более 100 человек. Было прислано около 50 докладов, из которых Программным комитетом было отобрано 36 докладов исследователей из ведущих университетов и научно-исследовательских структур. Программный комитет объединенной конференции возглавил профессор А. А. Пересецкий.

Программа совместных заседаний включала в себя пленарные доклады и тематические заседания. В этом году пленарные сессии открывались выступлением Р. Ибрагимова (Imperial College Business School, UK) “*Predictability of cryptocurrency returns: Evidence from robust tests*” (в соавторстве с Siyun He). Доклад органично сочетал в себе как обзор факторов, влияющих на ценообразование криптовалют, так и описание методов тестирования гипотез, робастных к проблемам финансовых временных рядов.

Ярким и очень эмоциональным было выступление Д. Фантаццини (МГУ) “*Hidden attraction to radical Islam and terrorist attacks*” (в соавторстве с М. Nicolini, University of Pavia, F. Sabatini, Sapienza – University of Rome). Авторам удалось оценить уровень радикализации общества с помощью информации, собираемой Google, и использовать ее для анализа вероятности террористических актов.

Очень интересным был доклад М. Житлухина (Математический институт им. В. А. Стеклова РАН) “*Sequential tracking of an unobservable two-state Markov process under Brownian noise*” (в соавторстве с А. Муравлевым, МИ РАН и М. Урусовым, Duisburg-Essen University). Авторы рассмотрели алгоритм выделения сигнала, в частности, определения моментов его переключения из одного состояния в другое.

Исследование И. Денисовой (РЭШ, МГУ, ЦЭМИ РАН) и В. Оксиненко (МГУ) “*Common labor market in the EAEU and households’ welfare: Impact evaluation analysis*” было посвящено анализу влияния создания региональных союзов (на примере Евразийского союза) на благосостояние домашних хозяйств. Проанализированы причины несколько неожиданного количественного результата об отсутствии положительного влияния миграции на благосостояние домашних хозяйств Армении.

Значительное место в программе было отведено работе тематических секций.

Секции «Теоретическая эконометрика и анализ временных рядов» и «Анализ временных рядов» собрали доклады, посвященные анализу временных рядов и различным финансовым и макроэкономическим приложениям, в том числе:

- А. Шведов, А. Бричикова, Е. Могилевич (НИУ ВШЭ, Москва), *Stock price modeling by fuzzy systems using wavelet transform*;
- F. M. Bandi (J. Hopkins University, Carey Business School, США; EDHEC-Risk Institute, Франция), А. Колоколов (Alliance Manchester Business School, Великобритания), D. Pirino (Universita degli Studi di Roma, Scuola Normale Superiore, Италия), R. Renò (Universita di Verona, Италия), *Realized moments: Identification and pricing*;
- E. P. Ribeiro, M. H. Migliari Ramalho (Federal University of Rio de Janeiro, Бразилия), *Ex-post evaluation of mean-variance cartel filters*;
- Д. Фантаццини, Н. Колодин (МГУ), *Does the hashrate affect the bitcoin price?*

Макроэкономической проблематике были посвящены доклады:

- П. Коваль, А. Полбин (Институт Гайдара, РАНХиГС), *Estimation of the consumption function of Russian households using RLMS microdata*;
- Д. Ломоносов, А. Полбин, Н. Фокин (РАНХиГС), *Estimation of the demand shocks impacts on main Russian macroeconomic variables using the BVAR model with sign and long-run restrictions*;
- В. Крамков, А. Максимов (Банк России, НИУ ВШЭ, Нижний Новгород), *Loan rates mark-ups and rational expectations*;
- М. Кириллова (РАНХиГС), *Macroeconomic effects of external shocks in Russian Federation: A GVAR approach*;
- В. Банникова, А. Пестова (МГУ, CERGE-EI, Prague, Чехия), *High-frequency identification for open economies: Interest rate policy effects in the case of Russia*.

Секции «Пространственная эконометрика и региональные исследования» и последовавшая за ней «Пространственная эконометрика и микроэконометрика» собрали не менее яркие доклады, связанные с инструментарием пространственной эконометрики:

- И. Булгаков, Е. Котырло (НИУ ВШЭ, Москва), *Fatherhood, marriage and labour market outcomes*;
- Е. Кадочникова, Н. Ларионова (КГУ, Казань), *Spatial analysis of the higher education accessibility determinants in the regions of Russia in the context of digital transformation*;
- Е. Корнейченко, А. Новопашина, Ю. Пыхтеев (ОГУ, Оренбург; АмГУ, Благовещенск; ННГУ, Нижний Новгород), *Exchange rate pass-through in Russian regions: Are the spatial dependences strong?*;
- О. Демидова, Е. Подколзина, Л. Кулецкая (НИУ ВШЭ, Москва), *Spatial modeling of voting preferences in Russian Federation*;
- О. Демидова, В. Прохоров (НИУ ВШЭ, Москва), *Sectoral and spatial aspects of beta-convergence in Russia*;
- Д. Горский (НИУ ВШЭ, Москва), *Probability of second birth and the maternity capital in Russia*.

Секция «Микроэконометрика» собрала доклады, связанные с оценкой потребительских предпочтений и рынком труда:

- Е. Коссова, И. Куприянова, Б. Потанин (НИУ ВШЭ, Москва), *Engel Curve semiparametric estimation under multivariate nonrandom selection*;

- E. Ribeiro (Federal University of Rio de Janeiro, Бразилия), *Employment effects of mergers: The case of private higher education in Brazil*;
- F. Cabrera-Hernandez (НИУ ВШЭ, Москва), *Leave them kids alone! The positive effect of abolishing grade repetition on dropout rates: Evidence from a policy change*.

В секции «Предприятия» были затронуты различные проблемы, связанные с оценкой эффективности фирм и их кредитного рейтинга, а также с механизмами роста их производительности:

- Е. Копнова, А. Грачева (НИУ ВШЭ, Москва; EDHEC Business School, Nice, Франция), *The impact of sovereign «ceiling» on corporate credit ratings in Russia*;
- А. Цветкова (Банк России, НИУ ВШЭ, Москва), *Productivity divergence at the firm level in Russia*;
- М. Рачинский, В. Тубденев (НИУ ВШЭ, Москва, МГУ), *Innovations through interactions in Russia*;
- Ю. Туровец (НИУ ВШЭ, Москва), *Efficiency determinants of Russian machine-building industries in the age of digitalization*.

В секции «Финансы и банки» были представлены доклады:

- Н. Пивницкая (НИУ ВШЭ, Москва), *Sovereign credit ratings and contagion effect on the financial markets of the Asian region*;
- А. Воронин, Е. Григоренко (НИУ ВШЭ, Москва), *Firm-specific financial characteristics and predictability of investors' response to its market news*;
- D. Livdan, N. Schürhoff, В. Соколов (University of California, Berkeley, США; University of Lausanne, Швейцария; НИУ ВШЭ, Москва), *Payment System and Real Economy*.

В заключительный день конференции вниманию участников были представлены доклады о различных эконометрических приложениях:

- Н. Ивашина, Ю. Шмидт (ДВФУ, Владивосток), *Assessment of migration policy efficiency in the Russian Far East*;
- Р. Хабибуллин, Д. Кошелев, А. Пономаренко (Банк России), *Financial development indicators and GDP growth at risk predictive credit gap measures*;
- С. Сидоров (СГУ, Саратов), *Growth Network model with preferred attachment at triadic formation step*;
- А. Силаев, М. Силаева, В. Силаева (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород), *Estimation of random change points of parameters in linear models of time series*;
- М. Тележкина, А. Максимов (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород), *Wage dynamics and university application decisions. Empirical analysis*.

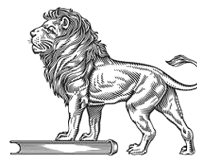
Конечно, онлайн-формат проведения мероприятия внес свои коррективы. Пришлось ограничить продолжительность ежедневных сессий до 3–3.5 часов, тем самым сократив число включенных в Программу докладов. Организаторы были вынуждены также отказаться от проведения студенческой преконференции. И, конечно, явно не хватало «кулуарных» обсуждений представленных результатов, проблем, перспектив.

Более подробную информацию о конференции можно получить на сайте <https://nnov.hse.ru/meta/2020/>.

Приглашаем всех желающих принять участие в Восьмой международной конференции «Современный эконометрический инструментарий и его приложения» (МЕТА2021), проведение которой планируется во второй половине сентября 2021 г. в Нижнем Новгороде.

А. Г. Максимов, Председатель Оргкомитета МЕТА2020,
В. А. Крамков, член Оргкомитета МЕТА2020

Издательский дом
«Дело» РАНХиГС
Москва, проспект Вернадского, д. 82
Тел.: (495) 433-25-02
delo@ranepa.ru



Издательский дом ДЕЛО

Готовятся к печати

В серии «Учебники Президентской академии»:

Я. Р. Магнус, П. К. Катышев, А. А. Пересецкий

Эконометрика. Начальный курс

9-е изд., испр. Москва: Издательский дом «Дело», 2021.



Учебник содержит систематическое изложение основ эконометрики и написан на основе лекций, которые авторы в течение ряда лет читали в Российской экономической школе и Высшей школе экономики. Подробно изучаются линейные регрессионные модели (метод наименьших квадратов, проверка гипотез, гетероскедастичность, автокорреляция ошибок, спецификация модели). Отдельные главы посвящены системам одновременных уравнений, методу максимального правдоподобия в моделях регрессии, моделям с дискретными, цензурированными и урезанными переменными. Глава «Панельные данные» дополняет книгу до полного списка тем, традиционно включаемых в современные базисные курсы эконометрики. Главы «Предварительное тестирование» и «Эконометрика финансовых рынков» будут полезны тем, кто интересуется соответственно теоретическими и прикладными аспектами эконометрики. Включены упражнения с реальными данными, доступными для читателя на веб-сайте учебника.

Для студентов, аспирантов, преподавателей, а также специалистов по прикладной экономике и финансам.

П. К. Катышев, Я. Р. Магнус, А. А. Пересецкий, С. В. Головань

Сборник задач к начальному курсу эконометрики

5-е изд., испр. — Москва: Издательский дом «Дело», 2021.



Сборник содержит подробные решения задач и упражнений по эконометрике из 7–9-го изданий учебника: Магнус Я. Р., Катышев П. К., Пересецкий А. А. Эконометрика. Начальный курс (Москва: Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2005–2021). В сборнике приведены также условия задач, поэтому он может использоваться в комплекте не только с указанным базовым учебником, но и с любым другим учебником по эконометрике. Сборник задач является первым изданием подобного типа на русском языке.

В новом издании значительно увеличилось количество задач, появились главы, соответствующие новым главам в учебнике, в частности «Панельные данные». Включены упражнения с реальными данными, доступными для читателя на веб-сайте книги.

В первую очередь задачник будет полезен студентам и аспирантам, изучающим эконометрику, а также преподавателям эконометрики и специалистам по прикладной экономике и финансам.

Где купить

Интернет-магазин: www.delo.ranepa.ru