



ВОСЬМАЯ МЕЖДУНАРОДНАЯ КОНФЕРЕНЦИЯ

«Современный эконометрический инструментарий и его приложения» (VIII International Conference “Modern Econometric Tools and Applications”, META2021)

С 23 по 25 сентября 2021 года проходила Восьмая международная конференция «Современный эконометрический инструментарий и его приложения» (VIII International Conference «Modern Econometric Tools and Applications», META2021). К большому сожалению участников и организаторов конференции, ограничения, связанные с пандемией и динамика ее развития в августе—сентябре вынудили отказаться от объявленного ранее смешанного формата проведения конференции на площадке Нижегородского кампуса НИУ ВШЭ. В результате META2021 прошла в режиме онлайн на интернет-платформе ZOOM. Для участия в конференции зарегистрировались более 100 человек. Было прислано более 50 докладов, из которых Программным комитетом, возглавляемым, как и на предыдущих конференциях, профессором А. А. Пересецким, было отобрано 38 докладов исследователей ведущих университетов и научно-исследовательских структур, в том числе: University of Sydney (Австралия), Imperial College Business School (Великобритания), Judge Business School, University of Cambridge (Великобритания), IAB Institute for Employment Research (Германия), Migration Policy Centre, European University Institute (Италия), Business School, University of Edinburgh (Великобритания), London Business School (Великобритания), London School of Economics (Великобритания), School of Management, Politecnico di Milano (Италия), Federal University of Rio de Janeiro (Бразилия), Humbolt University (Германия), Белорусский государственный университет (Беларусь), Российская экономическая школа, НИУ «Высшая школа экономики», Московский государственный университет им. М. В. Ломоносова, Санкт-Петербургский государственный университет, Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте РФ, Математический институт им. В. А. Стеклова РАН, Банк России, Аналитический Центр Правительства РФ и др.

Программа заседаний включала в себя пленарные доклады и тематические заседания. В этом году пленарные сессии открывались выступлением А. Прохорова (University of Sydney, Australia; СЕВА, СПбГУ) «*Yet another look at the omitted variable problem*», в котором автор рассказал о новых подходах к решению проблемы несостоятельности оценок в случае пропущенных переменных, основанных на использовании вспомогательного набора данных, содержащем информацию о пропущенной переменной. Завершил свой доклад А. Прохоров кратким анонсом мероприятий Центра эконометрики и бизнес-аналитики (ЦЭБА) СПбГУ.

Доклад Р. Ибрагимова (Imperial College Business School, UK; ЦЭБА, СПбГУ) «*Robust inference on income inequality: T-statistic based approaches*», в соавторстве с Р. Kattuman

(Judge Business School, University of Cambridge, UK) и А. Скроботовым (РАНХиГС; ЦЭБА, СПбГУ), был посвящен описанию робастного метода тестирования равенства показателей неравенства распределения (например доходов) нескольких групп экономических агентов.

Ярким и эмоциональным было выступление Д. Фантаццини (МГУ им. М. В. Ломоносова) «*Crypto-exchanges and credit risk: Modelling and forecasting the probability of closure*», в соавторстве с R. Calabrese (Business School, University of Edinburgh, UK). На основе анализа 144 криптовалютных бирж авторы предложили набор детерминант, позволяющих прогнозировать дееспособность бирж. Построенные в докладе разные типы моделей обладают достаточно хорошей прогнозной силой.

Большое впечатление на слушателей произвел не менее эмоциональный доклад С. Брызгаловой (London Business School, UK), в соавторстве с J. Huang (London School of Economics, UK) и С. Julliard (London School of Economics, UK) «*Bayesian solutions for the zoo: We just ran two quadrillion models*». В нем, в частности, авторы продемонстрировали особенности байесовского подхода для сравнения большого числа эмпирических моделей.

Очень интересным был доклад М. Житлухина (Математический институт им. В. А. Стеклова РАН) «*A diffusion approximation of a repeated prediction game*». Автор рассмотрел достаточно простую, на его взгляд, модель рынка с несколькими агентами. Модельные, но вполне понятные правила функционирования рынка и поведения агентов позволяют получить асимптотическое распределение богатства между агентами в зависимости от стратегии и параметров их поведения.

Значительное место в программе было отведено работе тематических секций, где обсуждался широкий спектр теоретических и прикладных вопросов эконометрики.

В секции **Health Economics** прозвучали доклады, связанные с отношением к здоровому образу жизни и удовлетворенностью жизнью, и, конечно, пандемией:

- М. Карцева, А. Пересецкий (НИУ ВШЭ, Москва) «*Sandwich generation: Its health behavior, health, and life satisfaction in Russia*»;
- М. Кириллова, А. Зубарев (РАНХиГС) «*Modeling COVID-19 spread in the Russian Federation using global VAR approach*»;
- Г. Бесстремьянная, С. Головань (РЭШ) «*Disentangling the impact of mean reversion in estimating policy response with dynamic panels*».

В докладах, представленных на секции **Labor Economics**, рассматривались различные аспекты, связанные с оплатой труда, эластичностью его предложения, ролью мигрантов, влиянием антиковидных мер и др.:

- E. R. T. G. Silva, E. P. Ribeiro (independent economist, Rio de Janeiro, Brazil; Instituto de Economia Universidade Federal do Rio de Janeiro, Brazil) «*The firm size wage effect for formal and informal workers*»;
- А. Полбин, А. Замниус (РАНХиГС, МГУ) «*The microdata-based estimation of labor supply elasticity in Russia*»;
- А. Дубновицкая (НИУ ВШЭ, Москва) «*Who is satisfied with their pay? An evidence from the Russian Longitudinal Monitoring Survey*»;
- А. Ниворожкин, F. Poeschel (IAB Institute for Employment Research, Germany; Migration Policy Centre, European University Institute, Italy) «*Working conditions in essential occupations and the role of migrants*»;

- Е. Котырло (НИУ ВШЭ, Москва) «*Impact of anti-COVID policies on unemployment in face-to-face and remote work spectrum*».

Доклады в секции **Time-series Analysis** были посвящены вопросам использования инструментария TSA для решения прикладных задач:

- Ю. Трифонов, Б. Потанин (НИУ ВШЭ, Москва) «*Semi-nonparametric multivariate GARCH model with dynamic correlation matrix*»;
- С. Селезнев (Банк России), Р. Хабибуллин (Банк России, НИУ ВШЭ, Москва), А. Галкин (Банк России) «*Infinite Markov Switching Bayesian VAR (iMSBVAR) as a forecasting tool in financial crises*».

Макроэкономической проблематике были посвящены и доклады секции **Macroeconometrics**:

- В. Крамков (Волго-Вятское ГУ Банка России, НИУ ВШЭ, Нижний Новгород), А. Максимов (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород) «*From free float to oil-free float: What has changed in Rur-Oil dependence*»;
- А. Елисеев (Волго-Вятское ГУ Банка России, НИУ ВШЭ, Нижний Новгород) «*Nowcasting in a DSGE model: The case of the Russian GDP*»;
- В. Банникова (МГУ) «*Exchange rate pass-through and multi-dimensional monetary policy in the Euro area*»;
- Д. Сугаипов (РАНХиГС) «*Modeling the impact of terms of trade news shocks on the Russian economy*»;
- В. Малюгин (БГУ, Беларусь) «*Using Markov-switching models with leading indicator to analyze the business cycle of the Belarusian economy*»;
- Н. Краснопеева (Аналитический Центр Правительства РФ, НИУ ВШЭ, Москва) «*Revenues and expenditures of Russian regional budgets: Granger analysis of causal relationship*».

Анализу процессов на финансовых рынках и свойств финансовых активов были посвящены доклады секций **Financial econometrics. Financial markets. Volatility** и **Banks, loans, risks, investments**:

- В. Балаш, А. Файзлиев, С. Сидоров (СГУ, Саратов) «*Time-frequency volatility spillovers across Russian stock market*»;
- В. Маневич (НИУ ВШЭ, Москва) «*Cryptocurrency market volatility*»;
- И. Якименко (Humboldt University, Germany; НИУ ВШЭ, Москва), М. Семенова (НИУ ВШЭ, Москва), Е. Зимин (НИУ ВШЭ, Москва) «*The more the better? Information sharing and credit risk*»;
- В. Соколов, А. Хайрутдинов (НИУ ВШЭ, Москва) «*Bond funds during the sovereign debt crisis: The Argentinian experience*»;
- А. Марков (Visa Consulting and Analytics, Москва; НИУ ВШЭ, Москва), Е. Трусевич, А. Филатов (Visa Consulting and Analytics, Москва) «*Card lifestyle clustering using ARTM*».

Секция **Spatial Econometrics** собрала не менее яркие доклады, связанные с использованием инструментария пространственной эконометрики, в том числе, для анализа региональных аспектов:

- К. Борзых, Ю. Пономарев, Д. Салимова (РАНХиГС) «*Spatial effects of origin-destination air passenger flow in Russia*»;
- О. Демидова, Е. Каяшева, А. Демьяненко (НИУ ВШЭ, Москва) «*The impact of public health spending on economic growth in Russia: A regional aspect*»;

- Е. Семерикова, А. Блохина (НИУ ВШЭ, Москва) «*The role of spartial effects in convergence of German regional housing markets*»;
- Е. Корнеева (НИУ ВШЭ, Москва) «*Homogeneity vs diversity of electoral space in post-soviet Russia: Application of spatial-econometric approach in electoral studies*».

В секции ***Inflation. Prices*** были представлены доклады о динамике цен на различные товары:

- Н. Никитина (РАНХиГС) «*Analysis of the house price dynamics in Russia*»;
- Т. Магжанов (МГУ, Москва) «*Forecasting the core inflation in Russia*»;
- М. Арсланов, Т. Ратникова (НИУ ВШЭ, Москва) «*Analysis of the dynamics of factors that determine the usefulness of video game consumers and forecasting their prices*».

В секции ***Productivity, efficiency. Firms*** прозвучали доклады:

- Г. Козляков (МГУ, РАНХиГС) «*The effect of 'Priority Development Area' program on firm performance in Russia*»;
- В. Афанасьев (НИУ ВШЭ, Санкт-Петербург), «*Can the conventional approach to bankruptcy prediction be applicable to Russian service firm?*».

На заключительном заседании вниманию участников конференции были представлены интересные доклады о различных эконометрических приложениях:

- Д. Стерхова, А. Аладышкина, В. Лакшина, Л. Леонова (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород) «*External effect in the environmental management economy: The problem of pollution*»;
- Е. Абалмасова, Т. Agasisti (НИУ ВШЭ, Москва; School of Management, Politecnico di Milano) «*Efficiency-based funding allocation for universities in Russia*»;
- А. Аистов, Е. Александрова, Ф. Гарипова, А. Хабибуллина (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород, НИУ ВШЭ, Санкт-Петербург) «*Problem-based learning in econometrics: Evidence from experimental data*».

Отдельно хочется подчеркнуть обратную связь в форме вопросов к докладчикам, полезных комментариев, иногда перераставших в дискуссии, которые, в силу ограниченности времени, не могли долго продолжаться. Участники подчеркивали содержательность комментариев А. А. Пересецкого, А. Б. Прохорова, П. К. Катышева, Г. Г. Канторовича, Р. М. Ибрагимова, Д. Фантаццини, М. В. Житлухина, Е. Рибейро, С. А. Брызгаловой, О. А. Демидовой, А. В. Аистова и др.

К сожалению, из-за онлайн-формата проведения конференции не хватало «кулуарных» обсуждений представленных результатов, проблем, перспектив и просто «живого» общения.

Более подробную информацию о конференции можно получить на сайте
<https://nnov.hse.ru/meta/2021/>.

Благодарим всех участников конференции МЕТА2021 за интересные выступления, полезные дискуссии и комментарии, создание атмосферы сотворчества. Приглашаем всех желающих принять участие в Девятой международной конференции «Modern Econometric Tools and Applications» (МЕТА2022), проведение которой планируется на 22–24 сентября 2022 г. в Нижнем Новгороде, и надеемся, что, в соответствии с высказанным практически всеми участниками конференции пожеланием, она состоится в очном формате.

А. Г. Максимов, Председатель Оргкомитета МЕТА2021