

БИБЛИОГРАФИЯ

НОВОЕ ИЗДАНИЕ УЧЕБНИКА ПО ЭКОНОМЕТРИКЕ*

Представляемый учебник, подготовленный коллективом авторов под редакцией члена-корреспондента РАН И.И. Елисеевой, отвечает современным требованиям, предъявляемым к учебникам для высших учебных заведений, и охватывает основные разделы эконометрики в современном ее понимании. Учебник содержит качественные учебно-методические материалы, необходимые для подготовки студентов, магистрантов и аспирантов по специальности «Статистика». Возрастающий интерес статистиков к эконометрике объясняется ее широкими возможностями в области моделирования реальных социально-экономических явлений и процессов. Использование эконометрических методов и моделей в научных исследованиях, в практике аналитической работы статистических, финансовых и экономических ведомств постоянно расширяется. В связи с этим возрастают необходимость уделять больше внимания преподаванию эконометрики при подготовке экономистов-статистиков. В рецензируемой работе предложены практически все основные направления эконометрического моделирования с той или иной степенью полноты изложения.

Весь обширный материал учебника разбит на 16 глав, в которых в строгой логической последовательности излагаются методы эконометрики, начиная с парной линейной регрессии и кончая специальными методами анализа панельных данных.

Первая глава посвящена, как принято, рассмотрению предмета и методов эконометрики, ее роли и месту в анализе. В этой же главе кратко рассмотрены история возникновения и развитие эконометрики как научной дисциплины. Это дает возможность обучающемуся получить представление об особенностях эконометрики как области современных знаний, увидеть ее отличие от теории статистики, математической статистики.

Во **второй главе** рассматриваются методы построения и оценивания моделей парной линейной и нелинейной регрессии. В отличие от большинства учебников по эконометрике, здесь, помимо традиционного метода наименьших квадратов, изложены подходы, используемые при оценивании параметров нелинейных моделей, которые трудно привести к линейному виду. В частности, излагается метод Бокса-Кокса.

Третья глава занимает самый большой объем в учебнике и является необходимой базой для достаточно глубокого изучения множественной регрессии. В ней достаточно полно представлены модели и методы регрессионного анализа, описываются отличительные характеристики множественных и частных уравнений регрессии, множественной и частной корреляции, а также методы оценки надежности результатов этих исследований с использованием критериев Фишера и Стьюдента. Кроме множественных регрессионных моделей традиционного вида, рассмотрены регрессионные модели с так на-

зывающими «фактивными» переменными, которые в современной практике анализа социально-экономических явлений и процессов являются весьма востребованными для целей расширения аналитических возможностей при использовании качественно неоднородных совокупностей. Например, при моделировании степени влияния уровня душевых доходов на потребительское поведение домашних хозяйств, расположенных в большом городе, в малом городе или в сельской местности, при моделировании сезонности. Помимо метода наименьших квадратов, изложен метод максимального правдоподобия для оценивания параметров регрессионной модели. Завершается третья глава параграфом, посвященным достаточно редким тобит-моделям. На наш взгляд, авторам следовало бы на конкретных примерах шире продемонстрировать основные этапы построения тобит-моделей и показать, как надо готовить исходные данные для их расчетов с использованием статистических пакетов, так как подобный материал не описан в популярной литературе по эконометрике.

Возможно, что ограниченный объем учебника не позволил авторам в данной главе рассмотреть особенности построения регрессионных моделей с дихотомическими зависимыми переменными (логит- и пробит-модели), которые представляют особый интерес, например, при решении таких задач, как оценка финансовой устойчивости предприятий, вероятности банкротства и т. п.¹.

Четвертая глава посвящена моделям с дискретной зависимой переменной. К ним авторы относят модели бинарного выбора и модели множественного выбора (с упорядоченными и неупорядоченными альтернативами). Включение в учебник данной главы (в первом издании ее не было) является хорошей задумкой авторов. Но при достаточно сложных теоретических выкладках почему-то отсутствуют иллюстративные примеры, которые позволили бы студенту быстрее и успешнее разобраться в моделях данного типа.

В **пятой главе** рассмотрены системы эконометрических уравнений, проблема идентификации таких моделей и методы оценивания параметров. Приведены очень хорошие примеры применения систем совместных (одновременных) уравнений, которые позволяют обучающемуся понять, какие именно типы задач можно решать с помощью такого вида эконометрических моделей. Что же касается описанного в этой главе путевого анализа, то он представляет собой интересный, достаточно сложный и поэтому редко используемый метод эконометрического моделирования, который позволяет существенно расширить аналитические рамки корреляционного и регрессионного методов с использованием рекуррентных систем уравнений для построения причинно-следственных цепочек с оценкой каждого их звена. Вводится понятие *импли-*

* Эконометрика: Учебник/ И.И. Елисеева, С.В. Курышева, Т.В. Костеева и др. Под ред И.И. Елисеевой. - 2-е изд., перераб. и доп. М.: Финансы и статистика, 2005.- 576 с.: ил.

¹Правда, в четвертой главе описываются пробит- и логит-модели без иллюстративных примеров.

цитного фактора, которое в предыдущем изложении не встречалось и требует более подробного пояснения, так как этот термин относится к математической логике, а не к эконометрике.

В *шестой главе* в достаточно полном объеме рассмотрены вопросы моделирования одномерных временных рядов на доступных примерах (автокорреляция, тенденция, сезонность).

Сложной и небольшой по объему является *седьмая глава* учебника (всего шесть страниц). В ней описываются стационарные стохастические процессы, вводятся понятия «*эргодичность*» и «*белый шум*». Такой стиль изложения материала, скорее, характерен для научной монографии, а не для учебника. Этот важный эконометрический раздел по своей сути и по объему вполне мог бы открывать *главу десятую* «Интегрируемые процессы», в которой поясняется, как проверить динамический ряд на стационарность и как его свести к стационарному ряду, если он таковым не является.

Главы *восьмая* и *девятая* очень важны для углубления знаний по эконометрике. Наличие их позволяет получить начальную информацию по вопросам моделирования нестационарных рядов, ознакомиться с тестами, используемыми для проверки стационарности. В то же время по стилю изложения материала они выпадают из общего контекста данного учебника. Большинство приводимых здесь примеров не числовые, а иллюстративные (как правило, графики). Недостаточной является экономическая интерпретация параметров приводимых диагностических функций (автокорреляционной и частной автокорреляционной функций), изложение в данной главе носит фрагментарный характер, что всегда вредит учебнику. Очень полезно было бы введение сквозного (для седьмой - девятой глав) числового примера, позволяющего проследить весь процесс анализа нестационарного временного ряда с использованием описываемых процедур и с хорошими содержательными выводами.

В *главе одиннадцатой* рассмотрены различные типы моделей ARIMA, перечислены все этапы моделирования временных рядов, приведены очень хорошие практические примеры по выбору типа моделей и по оценке их параметров.

Двенадцатая глава является логическим продолжением одиннадцатой, так как в ней описаны методы прогнозирования ARMA- и ARIMA-процессов с перечислением всех этапов, отмечены трудности, которые возникают при этом.

Небольшая по объему, но интересная по содержанию *глава тринадцатая* «Процессы ARCH и GARCH». В ней вводится понятие условной гетероскедастичности и описан алгоритм тестирования модели авторегрессии на условную гетероскедастичность; приведен пример моделирования динамического ряда доходности активов без пояснения полученных результатов. Степень сложности излагаемого материала требует более детальных числовых примеров с иллюстрацией и комментариями отдельных расчетных процедур, а главное, с экономической интерпретацией вычисленных параметров модели.

Наиболее удачной главой по изучению динамических моделей является *глава четырнадцатая*. Она посвящена изучению взаимосвязей на основании динамических рядов (временных совокупностей). Рассмотрены методы исключения тенденции (метод отклонения от тренда, метод последовательных разностей, включение в модель фактора времени) и метод оценивания регрессионных параметров при наличии автокорреляции в остатках. В заключительном параграфе главы

вводится понятие *коинтеграции* временных рядов и на примере рассматриваются два метода тестирования рядов динамики на коинтегрируемость: по критерию Энгеля-Грангера и по критерию Дарбина-Уотсона. Теоретические выкладки проиллюстрированы на примере. На основании полученных результатов сделаны выводы с хорошим экономическим обоснованием.

В *пятнадцатой главе* описаны сущность и методы оценивания моделей с распределенным лагом, моделей авторегрессии, моделей аддитивных ожиданий и моделей с неполной корректировкой ошибок.

Модели с распределенным лагом относятся к достаточно распространенным типам эконометрических моделей, которые можно широко применять, например, в анализе взаимосвязи макроэкономических показателей. В работе изложены два метода оценивания параметров моделей с распределенным лагом: метод Койка и метод Алмон. Рассмотрены проблемы, возникающие при построении моделей авторегрессии (они уже встречались нам в восьмой главе, где были описаны модели ARMA), описан метод инструментальных переменных. Далее автор отмечает, что для оценки параметров авторегрессионной модели может быть использован «метод максимального правдоподобия, рассмотрение которого выходит за рамки данного учебника». Но этот метод подробно изложен в этом учебнике в п. 3.12, на который можно было сослаться.

В заключительной *шестнадцатой главе* рассмотрены методы обработки панельных данных. Эти методы являются очень важными для исследователя, которому приходится работать с пространственно-временными статистическими совокупностями, а такая ситуация в аналитической практике возникает достаточно часто. Автором вводятся термины и обозначения, принятые в эконометрике панельных данных, описываются различные варианты реализации линейных моделей на основе панельных данных: обычная регрессия, несвязанные регрессии, кажущаяся несвязанной модель, фиктивные переменные, компоненты ошибки и случайные коэффициенты. Кроме перечисленных линейных моделей, рассматриваются модели с фиксированными эффектами. Приводимые примеры базируются на данных, выложенных в Интернет-источниках; все теоретические выкладки достаточно сложны (например, тесты на спецификацию моделей), но они позволяют читателю получить представление о современных эконометрических разработках.

При изложении наиболее сложных и трудоемких методов эконометрики в учебнике предусмотрено ознакомление студентов с возможностями реализации этих методов на компьютере с помощью современных статистических пакетов. В приложениях приведены динамические ряды статистических показателей по регионам России и основные статистико-математические таблицы, что облегчает и делает удобной организацию учебного процесса.

Представляемый учебник охватывает основные направления эконометрики и может быть успешно использован в качестве базового учебно-методического пособия при изучении эконометрики студентами экономических специальностей. Кроме того, он послужит серьезным подспорьем аспирантам и преподавателям, занимающимся серьезными научными исследованиями в области статистики и эконометрики.

Л.А. Сошникова, канд. экон. наук,
Белорусский государственный экономический университет

ОФИЦИАЛЬНЫЕ ДОКУМЕНТЫ

Постановления Федеральной службы государственной статистики об утверждении форм федерального государственного статистического наблюдения*

4 февраля 2005 г. № 10

Об утверждении формы федерального государственного статистического наблюдения за поступлением и расходованием средств государственных внебюджетных фондов на 2005 год

Федеральная служба государственной статистики постановляет:

1. Утвердить прилагаемую квартальную форму федерального государственного статистического наблюдения № 9-Ф «Сведения о поступлении и расходовании средств государственных внебюджетных фондов» и ввести ее в действие с отчета за январь–март 2005 года.

2. Установить представление государственной статистической отчетности по указанной в п. 1 настоящего постановления форме федерального государственного статистического наблюдения в адреса и сроки, установленные в форме, центральными исполнительными органами государственных внебюджетных фондов; внебюджетными фондами федеральных органов исполнительной власти для финансирования научных исследований и экспериментальных разработок; внебюджетными фондами органов исполнительной власти субъектов Российской Федерации и коммерческих организаций для финансирования научных исследований и экспериментальных разработок; территориальными фондами социальной поддержки населения, территориальными фондами обязательного медицинского страхования субъектов Российской Федерации; отделениями Пенсионного фонда Российской Федерации, региональными отделениями Фонда социального страхования Российской Федерации.

3. С введением указанного в п. 1 настоящего постановления статистического инструментария признать утратившей силу форму федерального государственного статистического наблюдения № 9-Ф, утвержденную постановлением Госкомстата России от 02.10.2002 № 191.

7 февраля 2005 г. № 12

Об утверждении формы федерального государственного статистического наблюдения за реализацией мер социальной поддержки отдельных категорий граждан на 2005 год

Федеральная служба государственной статистики постановляет:

1. Утвердить прилагаемую месячную форму федерального государственного статистического наблюдения № 2-соцподдержка «Сведения о реализации мер социальной поддержки отдельных категорий граждан по расходным обязательствам субъектов Российской Федерации» и ввести ее в действие с отчета за январь–февраль 2005 года.

2. Установить представление государственной статистической отчетности по указанной в п. 1 настоящего постановления форме федерального государственного статистического наблюдения в адреса и сроки, установленные в форме – органами исполнительной власти субъектов Российской Федерации.

3. С введением указанного в п. 1 настоящего постановления статистического инструментария признать утратившими силу формы федерального государственного статистического наблюдения № 2-соцподдержка (краткая) и № 2-соцподдержка, утвержденные постановлением Росстата от 28.12.2004 № 154.

21 февраля 2005 г. № 17

Об отмене форм федерального государственного статистического наблюдения за использованием государственных финан-

совых средств, направленных на мероприятия по реструктуризации угольной промышленности

Федеральная служба государственной статистики постановляет:

1. Отменить с отчета за январь–март 2005 года квартальные формы федерального государственного статистического наблюдения, утвержденные постановлением Росстата от 09.07.2004 № 25:

№ 1-ГП (уголь) «Сведения об использовании государственных финансовых средств, направленных на мероприятия по реструктуризации угольной промышленности»;

№ 2-ГП (уголь) «Сведения об использовании государственных финансовых средств, направленных на реализацию программ местного развития и обеспечения занятости для шахтерских городов и поселков»;

Приложение к форме № 1-ГП (уголь) «Сведения об использовании государственных финансовых средств, направленных на мероприятия по реструктуризации угольной промышленности (технические работы по ликвидации)».

2. Отменить с отчета за январь–март 2005 года Инструкцию по заполнению форм федерального государственного статистического наблюдения за использованием государственных финансовых средств, направленных на мероприятия по реструктуризации угольной промышленности [формы № 1-ГП (уголь), № 2-ГП (уголь)], Приложение к форме № 1-ГП (уголь), утвержденные постановлением Госкомстата России от 12.11.2002 № 212.

22 февраля 2005 г. № 18

Об утверждении статистического инструментария для организации Росморречфлотом статистического наблюдения за деятельностью морского и речного транспорта

Федеральная служба государственной статистики постановляет:

1. Утвердить представленные Федеральным агентством морского и речного транспорта прилагаемые формы федерального государственного статистического наблюдения, сбор и обработка данных по которым централизованы в системе Росморречфлота, и ввести их в действие:

месячные с отчета за февраль 2005 года:

№ ДМ-2 (срочная) «Сведения о работе морских портов»;

№ ДМ-3 (срочная) «Сведения о перевозках грузов и пассажиров и бюджетном времени российских морских судов»;

№ 10-ВТ (срочная) «Сведения об отправленных грузах внутренним водным транспортом»;

№ 12-ВТ (срочная) «Сведения об отправлении грузов и пассажиров внутренним водным транспортом»;

квартальные с отчета за I квартал 2005 года:

№ ДМ-4 «Сведения о перевозках грузов морским транспортом в заграничном плавании по странам»;

№ М-7 «Сведения о погрузочно-разгрузочных работах в морских портах»;

№ М-10 «Сведения об отправлении грузов и пассажиров морским транспортом по видам плавания»;

годовые с отчета за 2005 год:

№ 1-ПК (мор) «Сведения об использовании портовых комплексов на морском транспорте»;

№ М-1 «Сведения об отправлении и прибытии судов по видам плавания и национальности флага судов»;

№ М-3 «Сведения о междупортовых перевозках грузов морским транспортом во всех видах плавания (по направлению)»;

№ М-11 «Сведения о работе и использовании морских транспортных судов»;

№ ГМ-20 «Сведения о наличии морских судов и их характеристика»;

№ 26-М (ТТС) «Сведения о перевозках грузов с применением транспортно-технологических систем (ТТС) и средствах укрупнения грузов (СУГ)»;

№ 53-М (суд) «Сведения о наличии морских судов в Российской Федерации»;

№ 1-ВТ «Сведения о поступлении, выбытии и наличии транспортных и

*Тексты постановлений Федеральной службы государственной статистики об утверждении форм федерального государственного статистического наблюдения приводятся без приложения форм.

вспомогательных судов в эксплуатационных предприятиях внутреннего водного транспорта»;

№ 2-ВТ «Сведения о поступлении, выбытии и наличии технических и обслуживающих судов на предприятиях внутренних водных путей»;

№ 5-ВТ «Сведения об использовании пассажирских и грузопассажирских судов внутреннего водного транспорта на перевозках»;

№ 6-ВТ «Сведения об использовании самоходных сухогрузных и навальных судов внутреннего водного транспорта на перевозках»;

№ 7-ВТ «Сведения об использовании балкированных судов внутреннего водного транспорта на перевозках»;

№ 8-ВТ «Сведения об использовании несамоходных сухогрузных и навальных судов внутреннего водного транспорта на перевозках»;

№ 11-ВТ «Сведения о региональных и межрегиональных перевозках грузов и пассажиров внутренним водным транспортом»;

№ 14-ВТ «Сведения о перевозках грузов внутренним водным транспортом в контейнерах и пакетами»;

№ 15-ВТ «Сведения о приеме и передаче грузов в портах внутреннего водного транспорта»;

№ 20-ВТ «Сведения о протяженности внутренних водных путей»;

№ 21-ВТ «Сведения о размерах действующей обстановки на обслуживающих внутренних водных путях»;

№ 22-ВТ «Сведения о технической оснащенности и объемах перегрузочных работ эксплуатационных предприятий внутреннего водного транспорта».

2. Установить представление государственной статистической отчетности по указанным в п. 1 настоящего постановления формам федерального государственного статистического наблюдения в адреса и сроки, установленные в формах:

№ ДМ-2 (срочная), № ДМ-3 (срочная), № ДМ-4, № М-7, № М-10, № 1-ПК (мор.), № М-1, № М-3, № М-11, № 26-М (ТТС) - юридическими лицами, осуществляющими деятельность на морском транспорте (по перечню, установленному Росморречфлотом);

№ ГМ-20 - юридическими лицами - владельцами морских судов (по перечню, установленному Росморречфлотом);

№ 53-М (суд) - Главным управлением Российского морского регистра судоходства;

№ 10-ВТ (срочная), № 12-ВТ (срочная), № 1-ВТ, № 5-ВТ, № 6-ВТ, № 7-ВТ, № 8-ВТ, № 11-ВТ, № 14-ВТ, № 15-ВТ, № 22-ВТ - юридическими лицами, осуществляющими деятельность на внутреннем водном транспорте (по перечню, установленному Росморречфлотом): не имеющими обособленных подразделений; имеющими обособленные подразделения с учетом всех обособленных подразделений;

№ 2-ВТ - юридическими лицами, осуществляющими деятельность на внутреннем водном транспорте - государственными бассейновыми управлениями водных путей и судоходства, Федеральным государственным унитарным предприятием «Канал им. Москвы»;

№ 20-ВТ, № 21-ВТ - районами водных путей и гидроузлов (РВП и С и РГС и С).

3. С введением указанного в п. 1 настоящего постановления статистического инструментария признать утратившими силу формы федерального государственного статистического наблюдения:

№ ДМ-2 (срочная), № ДМ-3 (срочная), № ДМ-4, № М-7, № М-10, № 1-ПК, № М-1, № М-3, № М-11, № ГМ-20, № 26-М (ТТС), № 53-М (суд), утвержденные постановлением Госкомстата России от 27.10.2000 № 104 с изменениями, внесенными в них постановлениями Госкомстата России от 23.05.2002 № 124, от 03.09.2002 № 173;

№ 10-ВТ (срочная), № 12-ВТ (срочная), № 1-ВТ, № 2-ВТ, № 5-ВТ, № 6-ВТ, № 7-ВТ, № 8-ВТ, № 11-ВТ, № 14-ВТ, № 15-ВТ, № 21-ВТ, № 22-ВТ, утвержденные постановлением Госкомстата России от 21.11.2000 № 113 с изменениями, внесенными в них постановлениями Госкомстата России от 23.05.2002 № 124, от 03.09.2002 № 173;

№ 20-ВТ, утвержденную постановлением Госкомстата России от 15.10.2001 № 73 с изменениями, внесенными в нее с постановлениями Госкомстата России от 23.05.2002 № 124, от 03.09.2002 № 173.

4. Отменить формы федерального государственного статистического наблюдения:

- с отчета за 1-е полугодие 2005 года периодическую: № 23-ВТ, утвержденную постановлением Госкомстата России от 21.11.2000 № 113 с изменениями, внесенными в нее постановлениями Госкомстата России от 23.05.2002 № 124, от 03.09.2002 № 173;

- с отчета за 2005 год годовые:

№ 9-ВТ, № 16-ВТ, утвержденные постановлением Госкомстата России от 21.11.2000 № 113, с изменениями, внесенными в них постановлениями Госкомстата России от 23.05.2002 № 124, от 03.09.2002 № 173;

№ М-19, № 24-М (несохр.), утвержденные постановлением Госкомстата России от 27.10.2000 № 104, с изменениями, внесенными в них постановлениями Госкомстата России от 23.05.2002 № 124, от 03.09.2002 № 173.

28 февраля 2005 г. № 19

Об утверждении статистического инструментария для организации статистического наблюдения за объемами продажи товаров на рынках

товаров на рынках

Федеральная служба государственной статистики постановляет:

1. Утвердить прилагаемые формы федерального государственного статистического наблюдения и ввести их в действие:

квартальные с отчета за II квартал 2005 года:

№ Б-1 «Блокнот регистрации размеров продажи и цен на товары на вещевых рынках»;

№ Б-1с «Блокнот регистрации размеров продажи и цен на товары на смешанных рынках»;

№ Б-1п «Блокнот регистрации размеров продажи и цен на товары на продовольственных рынках»;

№ Б-1сельхоз «Блокнот регистрации размеров продажи и цен на товары на сельскохозяйственных рынках»;

№ Б-1строй «Блокнот регистрации размеров продажи и цен на товары на рынках строительных материалов»;

периодическую отчетность по состоянию на 1 мая 2005 года:

№ 3-рынок «Сведения о числе торговых мест на обследуемых рынках».

2. Установить представление государственной статистической отчетности по указанным в п. 1 настоящего постановления формам федерального государственного статистического наблюдения в адреса и сроки, установленные в формах:

- № Б-1в, № Б-1с, № Б-1п, № Б-1сельхоз, № Б-1строй - интервьюерами (регистратурами);

- № 3-рынок - юридическими лицами, их обособленными подразделениями (включая малые предприятия), индивидуальными предпринимателями, основным видом деятельности которых является сдача внаем участков, имущества, торговых мест на территории, отведенной органами исполнительной власти (муниципальными органами) под рынки.

3. С введением указанного в п. 1 настоящего постановления статистического инструментария признать утратившими силу:

- форму федерального государственного статистического наблюдения № Б-1, таблицы № Р-1, № Р-2, утвержденные постановлением Федеральной службы государственной статистики от 16.07.2004 № 30.

17 марта 2005 г. № 20

О внесении изменений в форму федерального государственного статистического наблюдения № 1-ЕДВ «Сведения о ежемесячных денежных выплатах отдельным категориям граждан в связи с изменением формы предоставления льгот по расходным обязательствам Российской Федерации»

Федеральная служба государственной статистики постановляет:

1. Внести по представлению Пенсионного фонда Российской Федерации следующие изменения в постановление Росстата от 28.12.2004 № 154 «Об утверждении статистического инструментария для организации статистического наблюдения за реализацией мер социальной поддержки отдельных категорий граждан на 2005 год»:

| Представляют: | Сроки представления |
|--|--------------------------------------|
| Рай(гор)управления (отделы) Пенсионного фонда Российской Федерации | на 15-й день после отчетного периода |
| - региональному отделению Пенсионного фонда Российской Федерации | на 25-й день после отчетного периода |
| Исполнительная дирекция Пенсионного фонда Российской Федерации: | на 35-й день после отчетного периода |
| - Росстату по согласованной программе | |

1.1. Изложить адресную часть и сроки представления формы федерального государственного статистического наблюдения № 1-ЕДВ «Сведения о ежемесячных денежных выплатах отдельным категориям граждан в связи с изменением формы предоставления льгот по расходным обязательствам Российской Федерации» в следующей редакции:

1.2. Изложить абзац 5 п. 2 постановления Росстата от 28.12.2004 № 154 в следующей редакции:

№ 1-ЕДВ - рай(гор)управлениями (отделами) Пенсионного фонда Российской Федерации.

2. Ввести действие указанные в п. 1 настоящего постановления изменения с 1 января 2005 года.