

КНИЖНАЯ ПОЛКА

Соколов М. В., Подкорытова О. А. Анализ временных рядов: учеб. пособие для бакалавриата и магистратуры. М.: Юрайт, 2016. 266 с.

Мир каждый видит в облике ином,
и каждый прав: так много смысла в нем.

И. В. Гете

Авторами учебного пособия «Анализ временных рядов» являются канд. физ.-мат. наук, доцент кафедры экономической кибернетики экономического факультета Санкт-Петербургского государственного университета, доцент факультета экономики Европейского университета в Санкт-Петербурге О. А. Подкорытова и канд. экон. наук, доцент кафедры экономической кибернетики экономического факультета Санкт-Петербургского государственного университета, доцент факультета экономики Европейского университета в Санкт-Петербурге, заместитель директора по науке Санкт-Петербургского экономико-математического института Российской академии наук М. В. Соколов.

Данное учебное пособие предназначено для бакалавров и магистров экономического направления. Тем не менее после изучения данной книги складывается ощущение сухости изложения информации, отсутствия развернутой интерпретации результатов и насыщенности примерами, что больше характерно для литературы математического направления. По этой причине можно сделать вывод, что данное учебное пособие больше подходит студентам, изучающим математику, и тем магистрантам экономических специальностей, которые ранее изучали анализ временных рядов. По нашему мнению, образцом учебной литературы для студентов-экономистов можно считать всем известный учебник «Эконометрика» под ред. И. И. Елисеевой.

В представленной книге определенно можно открыть для себя что-то новое. Например, гл. 4 «Тесты на единичные корни» содержит более полную информацию, если соотносить с большинством изданных русскоязычных учебников. Данная глава включает в себя не только всем известный тест на стационарность Дики–Фуллера, но и тест Филлипса–Перрона, тест *KPSS*, тест Перрона, а также тест Зивота–Эндрюса и *HEGY*. Правда, все эти тесты описаны в данном пособии достаточно кратко, и только взяв какой-либо иностранный учебник в руки, можно разобраться. Информация, безусловно, очень полезная и пригодится при решении задач временных рядов. Описание нам показалось достаточно закрытым для студента бакалавра. Есть шанс разобраться слушателю магистерской программы, если основы уже были изучены.

Особый интерес в рецензируемом учебном пособии вызывает гл. 6 «Векторная авторегрессия» и гл. 7 «Векторная авторегрессия и коинтеграция». Это обусловлено, прежде всего, тем, что эти темы относительно новые, особенно если касаться русскоязычной учебной литературы. На сегодняшний день наиболее полную информацию по данным направлениям эконометрики можно получить из англоязычных учебников, в том числе из тех, которые включены в библиографический список, представленный авторами. Глава 6 включает в себя набор формул и краткое описание модели *VAR*. Если читать эту главу в качестве приложения к учебнику, где это подробно описано, то появляется возможность разобраться. В противном случае могут возникнуть трудности. В дальнейшем же это учебное пособие можно использовать как шпаргалку для освежения в памяти

формул. На протяжении всей главы рассматривается один пример, при разборе которого невольно возникает ощущение, что это лишь демонстрация расчетов, но не экономическое описание. Весьма полезна представленная в этой главе математическая интерпретация моделирования векторной авторегрессии.

Глава 7 раскрывает вкратце некоторые моменты при работе с векторными моделями коррекции ошибок. Векторные модели коррекции ошибок несут в себе большую ценность по сравнению с простой моделью векторной авторегрессии. В *VECM* появляется возможность не только проследить краткосрочные отношения переменных, но и рассмотреть их долгосрочный характер. Появляется возможность интерпретации в отличие от *VAR* модели, и авторы упомянули это. Глава начинается с математической записи данной модели. Периодически между формулами даются частичные объяснения. Лично я не являюсь противником математических формул, совсем наоборот. Фактически математическая интерпретация — это и есть суть модели. Эта манера изложения хороша для математиков; для экономистов тоже, но гораздо в меньшей степени. Представлен интересный параграф «Разложение Бевериджа–Нельсона», но нет объяснения, зачем это сделано. В отличие от предыдущей главы, примеров в седьмой главе чуть больше. Авторами рассмотрены основы процедуры построения *VECM*; в пар. 7.7 в общих чертах представлены все эти этапы с точки зрения программы *Gretl*. Глава 7 требует вдумчивой проработки, лично я возвращался к ней не раз.

Учебное пособие «Анализ временных рядов» нацелено на решение задач с использованием эконометрических пакетов. Само развитие новых технологий подталкивает исследователей, ученых к новым темам в обширном курсе «Эконометрика». Такое положение вещей оптимистично и говорит о том, что преподавание эконометрики в России, при многих негативных факторах, тем не менее, движется вперед — медленно, но верно.

Особое внимание также стоит обратить на такую часть учебного пособия, как приложения. Из них можно подчерпнуть полезный справочный материал по использованию не только эконометрического пакета *Gretl*, но и пакета *Eviews*. Приложения не несут в себе полноценного методического материала по работе с пакетом программ, но помогают в изучении работы программ, а также полезны в части напоминания ранее забытых операций.

Данное учебное пособие может быть полезно больше магистрантам, чем бакалаврам. Для самостоятельного изучения направления анализа временных рядов эта книга очень сложна и не раскрывает многих моментов. Очевидно, ценность данного пособия в математическом инструментарии. Слабой стороной является отсутствие примеров и интерпретация некоторых моментов. При этом учебное пособие, как было замечено ранее, содержит обильное количество формул и математических записей, что подталкивает к мысли о ее математической направленности, а не экономической, как позиционируется изначально. В целом можно сделать вывод о том, что рецензируемая книга может быть полезна любому человеку, изучающему временные ряды и желающему расширить свои знания в математической сущности моделей.

М. О. Паньков

Санкт-Петербургский государственный экономический университет