



СЕМИНАР
«ПРИКЛАДНАЯ ЭКОНОМЕТРИКА»
15–16 апреля 2022



**XXIII Апрельская международная научная
конференция НИУ ВШЭ по проблемам
развития экономики и общества**



WORKSHOP
«APPLIED ECONOMETRICS»
15–16 April 2022



**XXIII April International Academic Conference on
Economic and Social Development**

**Департамент Прикладной экономики
Факультета Экономических Наук НИУ ВШЭ
Национального Исследовательского Университета
Высшая Школа Экономики**

Семинар «Прикладная Эконометрика»

Оргкомитет Семинара

Авдашева С. Б. (НИУ ВШЭ)
Аистов А. В. (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород)
Афанасьев М. Ю. (ЦЭМИ РАН)
Вакуленко Е. С. (НИУ ВШЭ)
Демидова О. А. (НИУ ВШЭ)
Канторович Г. Г. (НИУ ВШЭ)
Катышев П. К. (НИУ ВШЭ)
Коссова Е. В. (НИУ ВШЭ)
Котырло Е. С. (НИУ ВШЭ)
Максимов А. Г. (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород)
Пересецкий А. А. (НИУ ВШЭ) (председатель)
Ратникова Т. А. (НИУ ВШЭ)

**The Department of Applied Economics
of the Faculty of Economic Sciences
of the National Research University «Higher School of Economics»**

Workshop “Applied Econometrics”

Seminar Organizing Committee

Avdasheva S. B. (HSE)
Aistov A.V. (HSE, Nizhny Novgorod)
Afanasyev M. Yu. (CEMI RAS)
Vakulenko E. S. (HSE)
Demidova O. A. (HSE)
Kantorovich G. G. (HSE)
Katyshev P. K. (HSE)
Kossova E. V. (HSE)
Kotyrlo E. S. (HSE)
Maksimov A. G. (HSE, Nizhny Novgorod)
Peresetsky A. A. (HSE) (chairman)
Ratnikova T. A. (HSE)



Трансляция семинара будет проходить в Zoom.

Ссылка на конференцию: [https://us06web.zoom.us/j/88347009435?](https://us06web.zoom.us/j/88347009435?pwd=bnR6eGZrVmVYQTN2ZElTTERLbjJHQT09)

pwd=bnR6eGZrVmVYQTN2ZElTTERLbjJHQT09

Идентификатор конференции: 883 4700 9435

Код доступа: 888

Программа семинара
«Прикладная эконометрика»

Пятница, 15 апреля

9.30 – 10.00 Открытие.

10.00 – 10.50 Пленарное заседание (на английском)

Magnus, Jan (Frie Universitat, Амстердам, Нидерланды) **Andrey L. Vasnev** (University of Sydney, New South Wales, Australia) “On the uncertainty of a combined forecast: The critical role of correlation”.
(доклад снят)

10.50 – 11.10 Кофе-брейк

11.10 – 12.40 Пространственная эконометрика и региональные исследования (на английском)

Демидова О.А, Зюзин А.В. (НИУ ВШЭ, Москва) «Агломерационные эффекты отраслевой концентрации в России: межотраслевой анализ устойчивости (2011-2018 гг)»

Борзых К.А. (РАНХиГС, Москва) «Пространственный анализ вероятности трудовой миграции выпускников: влияние качества вузов»

Демьяненко А.В. (НИУ ВШЭ, Москва) «Региональные эффекты фискальной политики: анализ с помощью пространственных векторных регрессионных моделей»

Курбацкий А.Н., Шаклеина Е.И. (МГУ, МЭШ) «Экономический рост и выбросы углекислого газа в США и России: сравнительный пространственно – эконометрический анализ»

12.40 – 13.40 Обед

13.40 – 15.10 Макроэкономические и микроэкономические исследования (на английском)

Ribeiro E., Lima L. (Federal University of Rio de Janeiro) “Ex-post evaluation of recent mergers in the passenger air travel sector in Brazil”

Мовсесян Л. (НИУ ВШЭ) «Анализ и моделирование влияния внешних факторов на экономику России»

Елисеев А.В. (Банк России, Волго-Вятское ГУ), Силаев А.М. (НИУ ВШЭ, НН) *«Прогнозирование ВВП в режиме реального времени через призму DSGE модели»*

Полбин А.В. (РАНХиГС, Москва) *«Оценка параметров макроэкономической модели для РФ на основе метода минимизации расстояния между теоретическими и эмпирическими функциями импульсного отклика»*

15.10 – 15.30 Кофе-брейк

15.30 – 16.20 Пленарное заседание (на английском)

Arthur van Soest (Tilburg University, Тилбург, Нидерланды) **Johan Bonekamp** (Tilburg University, Тилбург, Нидерланды)

“Evidence of Behavioural Life-Cycle Features in Spending Patterns after Retirement”

(доклад снят)

16.20 – 16.40 Кофе-брейк

16.40 – 18.10 Исследования рынка труда и демографии (на английском)

Вакуленко Е.С. (НИУ ВШЭ, Москва) *«Исследование связи рождаемости в России с экономическими циклами»*

Горский Д. (НИУ ВШЭ, Москва) *«Рождаемость в России в периоды рецессий»*

Пестова А.А., Кашкаров Д.Р., Мамонов М.Е. (МГИМО) *«Уход и присмотр за детьми, дошкольное образование и предложение труда женщин с детьми в России: данные обследований домашних хозяйств»*

Замниус А.В., Полбин А.В. (РАНХиГС, Москва) *«Оценка эластичности предложения труда по заработной плате для замужних женщин в России»*

Суббота, 16 апреля

9:30 – 11.10 Пленарное заседание (на английском)

Прохоров А. (University of Sydney, Австралия) *"Dependence Modeling in Stochastic Frontier Analysis"*

Житлухин М. (Математический институт имени В. А. Стеклова Российской академии наук, Москва) *"Optimal growth equilibrium in a mean-field market"*

11.10 – 11.30 Кофе-брейк

11.30 – 12.20 Пленарное заседание (на английском)

Макарова С. (UCL School of Slavonic and East European Studies, Великобритания) *"Testing for policy effects in nonlinear time series model."*

(доклад снят)

12.20 – 12.40 Кофе-брейк

12.40 – 14.10 Теоретическая эконометрика (на английском)

Бесстремьянная Г. (НИУ ВШЭ, Москва), Головань С. (РЭШ, Москва)
«Неоднородный эффект влияния реформы финансирования на производительность японских больниц: квантильная регрессия с эндогенностью»

Курозуми Е. (Hitotsubashi University, Japan), Скроботов А. (РАНХиГС, Москва) *«On the asymptotic behavior of bubble date estimators»*

Потанин Б.С., Соломонов С. (НИУ ВШЭ, Москва),
«Полупараметрическая модификация КНВ метода»

Минасян В.В., Мирзоян Д.С., Сахнов А.М. (X5 Group) *«Оценка среднего эффекта воздействия на остатках: вывод смещения»*

14.10 – 15.10 Обед

15.10 – 16.20 Анализ временных рядов и макроэкономические исследования (на английском)

Малюгин В.И. (Белорусский государственный университет) *«Модели переключения состояний с опережающими индикаторами на основе микроданных и их применение для анализа и прогнозирования экономической активности в условиях шоков»*

Зямалов В.Е. (РАНХиГС) *«Применение многорежимных моделей к моделированию динамики российского фондового рынка»*

Сугаипов Д.Р. (РАНХиГС) *«Моделирование влияния новостных шоков условий торговли на российскую экономику»*

16.20 – 16.40 Кофе-брейк

16.40 – 18.10 Микроэконометрика

Афанасьев М., Кудров А. (ЦЭМИ РАН, Москва) *«»*

Крамков В.А. (Банк России, Волго-Вятское ГУ) Максимов А., (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород) *«Зависимость волатильности Российского финансового рынка от глобальных флуктуаций»*

Аистов А.В. (НИУ ВШЭ, Нижний Новгород), Александрова Е.А., Заздравных Е.А. (НИУ ВШЭ, Санкт-Петербург) *«Эластичность расходов на поддержание здоровья по доходу в России»*

Косорукова М.А., Коссова Е.В. (НИУ ВШЭ, Москва) *«Оценивание эффекта воздействия образования на здоровье индивида с помощью мэтчинга»*

18.10 Закрытие семинара

“Applied econometrics”
The program of the seminar

Friday, April 15

9.30 – 10.00 Registration

10.00 – 10.50 Plenary session (in English)

Magnus, Jan (Frie Universitat, Amsterdam, Netherlands) **Andrey L. Vasnev** (University of Sydney, New South Wales, Australia) “On the uncertainty of a combined forecast: The critical role of correlation”
(presentation is withdrawn)

10.50 – 11.10 Coffee-break

11.10 – 12.40 Regional Studies and Spatial Econometrics (in English)

Demidova O., Zyuzin A. (NRU HSE, Moscow) «*An agglomeration effect of the industry concentration in Russia: cross-industry study of stability over time (from 2011 to 2018)*»

Borzykh K. (RANEPA) «*Spatial Analysis of Graduates Propensity to Migrate: The Role of University Quality*»

Demyanenko A. (NRU HSE, Moscow) «*Regional Effects of Fiscal Policy: Analysis with Spatial Vector Autoregressive Models*»

Kurbatsky A, Shakleina E. (MSU, Moscow School of Economics) «*Economic growth and environmental pollution in the United States of America and Russia: comparative spatial econometric analysis*»

12.40 – 13.40 Lunch

13.40 – 15.10 Macro and Micro econometrics (in English)

Ribeiro E., Lima L. (Federal University of Rio de Janeiro) «*Ex-post evaluation of recent mergers in the passenger air travel sector in Brazil*»

Movsesyan L. (NRU HSE, Moscow) «*Modelling the Impact of External Factors on the Russian Economy: a Bayesian Vector Autoregressive Approach*»

Eliseev A. (CB, Nizhniy Novgorod), Silaev A. (NRU HSE, Nizhniy Novgorod) «*Real-Time GDP Forecast through the lens of the DSGE Model*»

Polbin A. (RANEPA) «*Impulse response function matching estimation of the Russian macroeconomic model*»

15.10 – 15.30 Coffee-break

15.30 – 16.20 Plenary session (in English)

Arthur van Soest (Tilburg University, Тилбург, Нидерланды) **Johan Bonekamp** (Tilburg University, Тилбург, Нидерланды)

«Evidence of Behavioural Life-Cycle Features in Spending Patterns after Retirement»

(presentation is withdrawn)

16.20 – 16.40 Coffee-break

16.40 – 18.10 Labor market and demographic research (in English)

Vakulenko E. (NRU HSE, Moscow) *«Study of the relationship between fertility in Russia and economic cycles»*

Gorsky D. (NRU HSE, Moscow) *«Fertility in Russia During Recessions»*

Pestova A., Kashkarov D., Mamonov M. (MGIMO University) *«Childcare Provision and Female Labor Supply in Russia: Evidence from the Household Survey Data»*

Zamnius A., Polbin A. (RANEPA, Gaidar Institute) *«Estimating labor supply elasticity for married women in Russia»*

Saturday, April 16

9.30 – 11.10 Plenary session (in English)

Prohorov A. (University of Sydney, Australia) «*Dependence Modeling in Stochastic Frontier Analysis*»

Zhitlukhin M. (Steklov Mathematical Institute of Russian Academy of Sciences, Moscow) «*Optimal growth equilibrium in a mean-field market*»

11.10 – 11.30 Coffee-break

11.30 – 12.20 Plenary session (in English)

Makarova S. (UCL School of Slavonic and East European Studies, UK)
«*Testing for policy effects in nonlinear time series model*»

(presentation is withdrawn)

12.20 – 12.40 Coffee-break

12.40 – 14.10 Theoretical econometrics (in English)

Besstremyannaya G. (NRU HSE), Golovan C. (NES) «*Heterogeneous effect of Japanese financing reform on productivity: a quantile regression approach with endogeneity*»

Kurozumi E. (Hitotsubashi University, Japan), Skrobotov A. (RANEPA) «*On the asymptotic behavior of bubble date estimators*»

Potantin B., Solomonov S. (NRU HSE), «*Semiparametric modification of KHB method*»

Minasyan V., Mirzoyan D., Sakhnov A. (X5 Group) «*Estimation of Average Treatment Effect on Residuals: Bias Derivation*»

14.10 – 15.10 Lunch

15.10 – 16.20 Time series analysis and macroeconomic studies (in English)

Malugin V. (Belarusian State University, Minsk, Belarus) «*Markov-Switching models with Leading Indicators based on microdata and their application to analyze and forecast economic activity under shocks*»

Zyamalov V. (RANEPA) «*Modeling of the Russian stock market dynamics using multi-regime models*»

Sugaipov D. (RANEPA) «*Modeling the impact of terms of trade news shocks on the Russian economy*»

16.20 – 16.40 Coffee-break

16.40 – 18.10 Microeconometrics

Afanasyev M., Kudrov A. (Central Economic Mathematical Institute of the Russian Academy of Sciences, Moscow) «»

Kramkov V.A. (Bank of Russia, Vyatka Main Branch of Bank of Russia)

Maksimov A. (NRU HSE, Nizhniy Novgorod) «*Measuring Russian financial market vulnerability to global fluctuations*»

Aistov A., Zazdravnykh E., Aleksandrova E. (NRU HSE, Nizhniy Novgorod) «*The income elasticity of health care spending in Russia*»

Kosorukova M., Kossova E. (NRU HSE, Moscow) «*Estimating treatment effect of education on health with matching*»

18.10 18.20 Closing



Контакты и аффилиация участников

<i>Kurozumi Eiji</i>	Hitotsubashi University, Japan	kurozumi@stat.hit-u.ac.jp
<i>Magnus Jan</i>	Frie Universitat, Amsterdam, Netherlands	jan@janmagnus.nl
<i>Ribeiro Eduardo Pontual van Soest Arthur</i>	Federal University of Rio de Janeiro, Бразилия	eribeiro@ie.ufrj.br
<i>Bonekamp Johan</i>	Tilburg University, Tilburg, Netherlands	A.H.O.vanSoest@uvt.nl
<i>Lima Leonardo de Castro</i>	Tilburg University, Tilburg, Netherlands	J.L.M.Bonekamp@tilburguniversity.edu
<i>Авдашева Светлана Борисовна</i>	Federal University of Rio de Janeiro, Бразилия	leonardodecastrolima@gmail.com
<i>Аистов Андрей Валентинович</i>	НИУ ВШЭ, Москва	avdash@hse.ru
<i>Александрова Екатерина Александровна</i>	НИУ ВШЭ, Нижний Новгород	aaistov@hse.ru
<i>Афанасьев Михаил Юрьевич</i>	НИУ ВШЭ, Нижний Новгород	ea.aleksandrova@hse.ru
<i>Бесстремьянная Галина Евгеньевна</i>	ЦЭМИ РАН, Москва	miafan@cemi.rssi.ru
<i>Борzych Ксения Аркадьевна</i>	НИУ ВШЭ, Москва	gbesstremyannaya@hse.ru
<i>Вакуленко Елена Сергеевна</i>	РАНХиГС, Москва	borzykh-ka@ranepa.ru
<i>Васнев Андрей Головань Сергей</i>	НИУ ВШЭ, Москва	evakulenko.ru
	University of Sydney, New South Wales, Australia	andrey.vasnev@sydney.edu.au
	РЭШ, Москва	sgolovan@nes.ru

Горский Дмитрий Ильич	НИУ ВШЭ, Москва	d.gorskiy8@gmail.com
Демидова Ольга Анатольевна	НИУ ВШЭ, Москва	demidova@hse.ru
Демьяненко Артём Владимирович	НИУ ВШЭ, Москва	ademyanenko@hse.ru
Елисеев Александр Валерьевич	Волго-Вятское ГУ Банка России	yeliseyev.alec@gmail.com
Житлухин Михаил Валентинович	Математический институт имени В. А. Стеклова РАН, Москва	zhitlukhin@gmail.com
Заздравных Евгений Александрович	НИУ ВШЭ, Санкт-Петербург	ezazdravnykh@hse.ru
Замниус Алексей Витальевич	РАНХиГС, Москва	Zamnius@iep.ru
Зюзин Александр Владимирович	АО «АБ РОССИЯ», НИУ ВШЭ	mr.a.zyuzin@gmail.com
Зямалов Вадим Евгеньевич	РАНХиГС, Москва	zyamalov@ranepa.ru
Кашкаров Даниил Романович	МГИМО, Москва	
Косорукова Мария Александровна	НИУ ВШЭ, Москва	makosorukova@edu.hse.ru
Коссова Елена Владимировна	НИУ ВШЭ, Москва	ekossova@hse.ru
Котырло Елена Станиславовн а Курбацкий	НИУ ВШЭ, Москва	ekotyrl@hse.ru
Алексей Николаевич	МГУ, МЭШ, Москва	kateshkln99@gmail.com
Кудров	ЦЭМИ РАН,	kovlal@inbox.ru

Александр Владимирович Макарова Светлана Борисовна	Москва	
Малюгин Владимир	UCL School of Slavonic and East European Studies, Лондон, Великобритания	s.makarova@ucl.ac.uk
Максимов Андрей Геннадьевич	Беларусский Государственный Университет	Malugin@bsu.by
Мамонов Михаил Евгеньевич	НИУ ВШЭ, Нижний Новгород	amaksimov@hse.ru
Мовсесян Левон	МГИМО, Москва	mikhmam@gmail.com
Минасян Ваагн Володяевич	НИУ ВШЭ, Москва	m.levon@yandex.ru
Мирзоян Диана Сергеевна	X5 Group	minasyanvaagn@mail.ru
Пересецкий Анатолий Абрамович	X5 Group	
Пестова Анна Андреевна	НИУ ВШЭ, Москва	aperesetsky@hse.ru
Полбин Андрей Владимирович	МГИМО	anna.pestova@cerge-ei.cz
Потанин Богдан Станиславович	РАНХиГС	apolbin@gmail.com
Прохоров Артём Борисович	НИУ ВШЭ, Москва	bogdanpotanin@gmail.com
Ратникова Татьяна Анатольевна	University of Sydney, Australia	artem.prokhorov@sydney.edu.au
Сахнов Александр Максимович	НИУ ВШЭ, Москва	taratnikova@yandex.ru
Силаев	X5 Group	
	НИУ ВШЭ,	asilaev@hse.ru

<i>Андрей Михайлович Скроботов Антон</i>	Нижний Новгород РАНХиГС	antonskrobotov@gmail.com
<i>Соломонов Семён Феликсович</i>	НИУ ВШЭ, Москва	solomonovsemen@gmail.com
<i>Сугаипов Дени Ризванович</i>	РАНХиГС	sugaipov-dr@ranepa.ru
<i>Шаклеина Екатерина Игоревна</i>	МГУ, МЭШ	kateshkln99@gmail.com



Contacts and Affiliations of Seminar Participants

<i>Afanasiev Mikhail</i>	Central Economic Mathematical Institute of the Russian Academy of Sciences, Moscow	miafan@cemi.rssi.ru
<i>Aleksandrova Ekaterina</i>	HSE University, Nizhniy Novgorod	ea.aleksandrova@hse.ru
<i>Aistov Andrey</i>	HSE University, Nizhniy Novgorod	aaistov@hse.ru
<i>Avdasheva Svetlana</i>	HSE University, Moscow	avdash@hse.ru
<i>Berendeeva Ekaterina</i>	HSE University, Moscow	berendkatya@gmail.com
<i>Besstremyannaya Galina</i>	HSE University, Moscow	gbesstremyannaya@hse.ru
<i>Bonekamp Johan</i>	Tilburg University, Tilburg	J.L.M.Bonekamp@tilburguni versity.edu
<i>Borzykh Ksenia</i>	RANEPa, Moscow	borzykh-ka@ranepa.ru
<i>Demidova Olga</i>	HSE University, Moscow	demidova@hse.ru
<i>Golovan Sergei</i>	New Economic School, Moscow	sgolovan@nes.ru
<i>Gorskiy Dmitriy</i>	HSE University, Moscow	d.gorskiy8@gmail.com
<i>Demyanenko Artem</i>	HSE University, Moscow	ademyanenko@hse.ru
<i>Eliseev Alexandr</i>	Bank of Russia (Volgo- Vyatka Main Branch)	yeliseyev.alec@gmail.com
<i>Kashkarov Daniil</i>	MGIMO University, Moscow	
<i>Kossova Elena</i>	HSE University, Moscow	ekossova@hse.ru
<i>Kotyrlo Elena</i>	HSE University, Moscow	ekotyrlo@hse.ru
<i>Kudrov Alexander</i>	Central Economic Mathematical Institute of the Russian Academy of Sciences, Moscow	kovlal@inbox.ru
<i>Kurbatsky</i>	Moscow State University	kateshkln99@gmail.com

Alexey		
Lima Leonardo de Castro	Federal University of Rio de Janeiro, Бразилия	leonardodecastrolima@gmail.com
Magnus Jan	Frie Universitat, Amsterdam	jan@janmagnus.nl
Makarova Svetlana	UCL School of Slavonic and East European Studies, London, UK	s.makarova@ucl.ac.uk
Maksimov Andrey	HSE University, Nizhniy Novgorod	amaksimov@hse.ru
Malugin Vladimir	Belarusian State University, Minsk, Belarus	Malugin@bsu.by
Mamonov Mikhail	MGIMO University, Moscow	mikhmam@gmail.com
Movsesyan Levon	HSE University, Moscow	m.levon@yandex.ru
Mirzoyan Diana	X5 Group, Moscow	
Peresetsky Anatoly	HSE University, Moscow	aperesetsky@hse.ru
Pestova Anna	MGIMO University, Moscow	anna.pestova@cerge-ei.cz
Polbin Andrey	RANEPA, Moscow	apolbin@gmail.com
Potantin Bogdan	HSE University, Moscow	bogdanpotanin@gmail.com
Prokhorov Artem	University of Sydney, Australia	artem.prokhorov@sydney.edu.au
Ratnikova Tatyana	HSE University, Moscow	taratnikova@yandex.ru
Ribeiro Eduardo Pontual	Federal University of Rio de Janeiro, Brazil	eribeiro@ie.ufrj.br
Sakhnov Aleksander	X5 Group, Moscow	kateshkln99@gmail.com
Shakleina Ekaterina	Moscow State University, Moscow School of Economics, Moscow	kateshkln99@gmail.com
Silaev Andrey	HSE University, Nizhniy Novgorod	asilaev@hse.ru
Skrobotov Anton	RANEPA, Moscow	antonskrobotov@gmail.com

van Soest Arthur	Tilburg University, Tilburg, Netherlands	A.H.O.vanSoest@uvt.nl
Solomonov Semen	HSE University, Moscow	solomonovsemen@gmail.com
Sugaipov Deni	RANEPA, Moscow	sugaipov-dr@ranepa.ru
Vasnev Andrey	University of Sydney, New South Wales, Australia	andrey.vasnev@sydney.edu.au
Vakulenko Elena	HSE University, Moscow	evakulenko@hse.ru
Zazdravnykh Evguenii	HSE University, Saint Petersburg	ezazdravnykh@hse.ru
Zamnius Alexander	Gaydar Institute, Moscow	Zamnius@iep.ru
Zhitlukhin Mikhail	Steklov Mathematical Institute of Russian Academy of Sciences, Moscow	zhitlukhin@gmail.com
Zyamalov Vadim	RANEPA, Moscow	zyamalov@ranepa.ru
Zyuzin Alexander	HSE University, Moscow	mr.a.zyuzin@gmail.com

