

# Советы изучающим эконометрику

## Где найти данные в сети?\*

Станислав Анатольев<sup>†</sup>

*Российская экономическая школа, Москва, Россия*

Александр Цыплаков<sup>‡</sup>

*Новосибирский государственный университет, Новосибирск, Россия*

Мы приводим тематические списки полезных веб-сайтов, на которых прикладной экономист может найти данные для исследований.

### Введение

В данном эссе содержатся списки полезных веб-сайтов, на которых прикладной экономист может найти данные для исследований. Авторы отдают себе отчет, что интернет меняется очень быстро и через пару лет многие из приведенных ссылок окажутся неактуальными. Тем не менее, эссе позволяет получить общее представление о диапазоне имеющихся в сети данных, названиях ресурсов, и т. п. Даже если какой-нибудь ресурс сменит URL-адрес, его можно будет отыскать по ключевым словам с помощью интернет-поиска.

Заметим, что ссылки не сортированы по значимости, и порядок перечисления довольно произволен.<sup>1</sup> Таким образом, то, что база данных Бюро переписи населения США указана прежде данных Мирового банка, ни в коей мере не означает, что данные по переписи населения следует считать более полезными. Читатель должен прибегнуть здесь к собственному здравому смыслу.

Для некоторых сайтов мы привели примеры данных, которые там можно найти, и цепочки надписей, по которым надо щелкать мышью. Это сделано для того, чтобы продемонстрировать потенциальную полезность соответствующей ссылки и помочь в навигации по сайтам.

### Данные, связанные с бизнесом и финансами

Здесь мы приводим только ссылки на общие международные данные, связанные с бизнесом и финансами. Ссылки на данные по России см. ниже.

- Служба Google Finance:

[finance.google.com](http://finance.google.com)

*Набрать в поле ввода «NASDAQ:MYGN» – [Get quotes] → [Historical Prices] ⇒ Данные о курсе акций компании Myriad Genetics на бирже NASDAQ по дням.*

- Служба Yahoo Finance:

[finance.yahoo.com](http://finance.yahoo.com)

\*Цитировать как: Анатольев, Станислав и Александр Цыплаков (2009) «Где найти данные в сети?», Квантиль, №6, стр. 59–71. Citation: Anatolyev, Stanislav, and Alexander Tsyplakov (2009) “Where to find data on the Web?” *Quantile*, No.6, pp. 59–71.

<sup>†</sup>Адрес: 117418, г. Москва, Нахимовский проспект, 47, офис 1721(3). Электронная почта: [sanatoly@nes.ru](mailto:sanatoly@nes.ru)

<sup>‡</sup>Адрес: 630090, г. Новосибирск, Весенний проезд, 6–44. Электронная почта: [tsy@academ.org](mailto:tsy@academ.org)

<sup>1</sup>В некоторых разделах ссылки расположены в порядке доменных имен второго или третьего уровня, в некоторых – по алфавиту.

- История валютных котировок – служба FXHistory:  
[www.oanda.com/convert/fxhistory](http://www.oanda.com/convert/fxhistory)  
*Starting Date: 01/01/00, Ending Date: 01/01/01, Swiss Franc to German Mark, Interbank rate ⇒ Курс швейцарского франка к германской марке за 2000 г., межбанковская ставка по дням.*
- Поисковик финансовых данных на сайте университета штата Огайо / Ohio State University – Department of Finance – Financial Data Finder:  
[fisher.osu.edu/fin/osudata.htm](http://fisher.osu.edu/fin/osudata.htm)
- Обменные курсы, в том числе исторические, от университета Британской Колумбии / University of British Columbia – PACIFIC – Foreign Exchange Daily and Historical Rates:  
[fx.sauder.ubc.ca](http://fx.sauder.ubc.ca)  
*[Database Retrieval] → Base Currency: U.S. Dollars, Target Currencies: British Pounds, Start Date: 1 Jan 1971, End Date: 31 Dec 1974, Data Frequency: daily – [Retrieve Data] ⇒ Курс британского фунта к доллару США за 1971–1974 гг. по дням.*
- Центр исследований цен активов бизнес-школы Чикагского университета (по институциональной подписке) / University of Chicago – Graduate School of Business – Center for Research in Security Prices (CRSP):  
[www.crsp.com](http://www.crsp.com)
- Система WRDS – данные от бизнес-школы Вортон Пенсильванского университета (по институциональной подписке) / University of Pennsylvania – The Wharton School – WRDS:  
[wrds.wharton.upenn.edu](http://wrds.wharton.upenn.edu)
- Бизнес-ссылки, собранные библиотекой университета Рутгерс / Rutgers University Libraries – Subject Research Guides – Business:  
[www.libraries.rutgers.edu/rul/rr\\_gateway/research\\_guides/busi/business.shtml](http://www.libraries.rutgers.edu/rul/rr_gateway/research_guides/busi/business.shtml)
- Глобальные финансовые данные (большая часть данных доступна лишь по платной подписке):  
[www.globalfindata.com](http://www.globalfindata.com)

## Международные данные

Данные по странам мира, в том числе данные различных международных организаций.

- Международная база данных Бюро переписи населения США / U.S. Census Bureau – International Data Base (IDB):  
[www.census.gov/ipc/www/idb](http://www.census.gov/ipc/www/idb)  
*[Tables] → Select one table: 028 Total Fertility Rate, Select output type: Spreadsheet mode [Омнравить запрос] → How to aggregate: Treat each region separately, Aggregation output options: Both region and country data, Select one or more regions: World, Select one or more years: all available years – [Go] ⇒ Данные об уровне рождаемости по странам мира с 1996 г. по годам.*
- Информационный бюллетень ЦРУ / CIA World Factbook:  
<https://www.cia.gov/library/publications/the-world-factbook>  
*Select a country or location: World → [Communications] → Telephones - mobile cellular: [Иконка с таблицей] ⇒ Количество мобильных телефонов по странам мира.*
- Международные данные по энергетике Управления энергетической информации США / Energy Information Administration (EIA) – International Energy Annual – International

Energy Data and Analysis:

[www.eia.doe.gov/emeu/iea](http://www.eia.doe.gov/emeu/iea)

- Форум по исследованиям в области эмпирики международной торговли / Forum for Research on Empirical International Trade (F.R.E.I.T.):  
[www.eiit.org/Resources.html](http://www.eiit.org/Resources.html)
- Продовольственная и сельскохозяйственная организация ООН (ФАО) / Food and Agriculture Organization of the United Nations (FAO) – Statistics:  
[www.fao.org/corp/statistics/en](http://www.fao.org/corp/statistics/en)
- Индекс экономической свободы / Index of Economic Freedom:  
[www.heritage.org/index/](http://www.heritage.org/index/)  
*[Ranking the Countries] ⇒ Рейтинг стран мира по индексу экономической свободы.*
- Интернет-центр исследований в области коррупции (совместная инициатива университета Пассау и организации Transparency International) / Internet Center for Corruption Research:  
[www.icgg.org](http://www.icgg.org)
- Энергетическая статистика от Международного энергетического агентства / International Energy Agency (IEA) – Energy Statistics:  
[www.iea.org/Textbase/stats](http://www.iea.org/Textbase/stats)
- Статистическое бюро Международной организации труда (МОТ) / International Labour Organization (ILO) – Bureau of Statistics:  
[www.ilo.org/stat](http://www.ilo.org/stat)  
*[LABORSTA – database of labour statistics] → [Strikes and Lockouts] → [Main statistics] → Select one or more countries/groups of countries: EUROPE, Select one or more tables: 9A, [Go] → [View] ⇒ Статистика забастовок и локаутов в странах Европы с 1998 г. (с пропусками).*
- Глобальные, финансовые и другие данные от Международного валютного фонда (МВФ) / International Monetary Fund (IMF) – Data and Statistics:  
[www.imf.org/external/data.htm](http://www.imf.org/external/data.htm)
- Люксембургское исследование доходов / Luxembourg Income Study:  
[www.lisproject.org](http://www.lisproject.org)
- Проект по обследованиям в области демографии и здравоохранения / Demographic and Health Surveys (MEASURE DHS):  
[www.measuredhs.com](http://www.measuredhs.com)
- Международная статистика и межстрановые сопоставления на сайте NationMaster / NationMaster – World Statistics, Country Comparisons:  
[www.nationmaster.com](http://www.nationmaster.com)
- Сайт Организации экономического сотрудничества и развития / Organization for Economic Co-operation and Development (OECD) – OECD Online:  
[www.oecd.org](http://www.oecd.org)
- База данных ООН по международной торговле товарами / UN comtrade – International Merchandise Trade Statistics (IMTS):  
[comtrade.un.org](http://comtrade.un.org)

- Единая система доступа к данным ООН UN data:  
[data.un.org](http://data.un.org)
- Система TRAINS Конференции ООН по торговле и развитию (ЮНКТАД) / United Nations Conference on Trade and Development (UNCTAD) – TRAINS (Trade Analysis and Information System):  
[r0.unctad.org/trains\\_new/index.shtm](http://r0.unctad.org/trains_new/index.shtm)
- Статистика по общественному развитию Программы развития ООН (ПРООН) / United Nations Development Programme (UNDP) – Human Development Reports – Statistics:  
[hdr.undp.org/en/statistics](http://hdr.undp.org/en/statistics)
- Статистический институт Организации ООН по вопросам образования, науки и культуры (ЮНЕСКО) / United Nations Educational, Scientific and Cultural Organization (UNESCO) – Institute for Statistics:  
[www.uis.unesco.org](http://www.uis.unesco.org)
- Отдел статистики ООН / United Nations Statistics Division:  
[unstats.un.org](http://unstats.un.org)
- База данных о неравенстве доходов по странам мира от университета ООН / World Institute for Development Economics Research of the United Nations University (UNU-WIDER) – World Income Inequality Database:  
[www.wider.unu.edu/research/Database/en\\_GB/database/](http://www.wider.unu.edu/research/Database/en_GB/database/)
- Данные Центра международных сопоставлений Пенсильванского университета о паритетах покупательной способности и счетах национального дохода по большому количеству стран мира с 1950 года / University of Pennsylvania – Center for International Comparisons of Production, Income and Prices – Penn World Table:  
[pwt.econ.upenn.edu](http://pwt.econ.upenn.edu)
- Статистическая информационная система Всемирной организации здравоохранения (ВОЗ) / World Health Organization (WHO) – Statistical Information System (WHOSIS):  
[www.who.int/whosis](http://www.who.int/whosis)
- Данные Мирового банка / World Bank Data & Research  
[econ.worldbank.org](http://econ.worldbank.org)  
*[Research] → [Projects & Programs] → [Living Standards Measurement Study (LSMS)] → [LSMS Survey Finder] → Make selection(s): Tajikistan ⇒ Данные обследования жизненного уровня по Таджикистану за 1999 и 2003 гг.*
- Международные данные о торговле и тарифах от Всемирной торговой организации (ВТО) / World Trade Organization (WTO) – International trade and tariff data:  
[www.wto.org/english/res\\_e/statis\\_e/statis\\_e.htm](http://www.wto.org/english/res_e/statis_e/statis_e.htm)

### Данные по отдельным регионам мира

- Данные Азиатского банка развития / Asian Development Bank – Economics and Statistics:  
[www.adb.org/Economics](http://www.adb.org/Economics)
- Статистическое бюро Европейского сообщества / Statistical Office of the European Communities (Eurostat):  
[epp.eurostat.ec.europa.eu](http://epp.eurostat.ec.europa.eu)

- Экономическая комиссия стран Латинской Америки и Карибского бассейна / Comisión Económica para América Latina (CEPAL) / Economic Commission for Latin America and the Caribbean (ECLAC):  
[www.eclac.cl](http://www.eclac.cl)
- Данные Межамериканского банка развития / Inter-American Development Bank – Research & Data:  
[www.iadb.org/research](http://www.iadb.org/research)
- Статистический отдел Экономической и социальной комиссии ООН по азиатско-тихоокеанскому региону / United Nations Economic and Social Commission for Asia and the Pacific (UNESCAP) – Statistics Division:  
[www.unescap.org/stat](http://www.unescap.org/stat)
- Статистический отдел Экономической комиссии ООН по Европе / United Nations Economic Commission for Europe (UNECE) – Statistical Division:  
[www.unece.org/stats](http://www.unece.org/stats)  
*[Get statistics on-line] → [Forest Resources] → [Area of forest...] → Availability for Wood Supply: Forest, Forest Type: Total, Country: Select all, Year: 2005 ⇒ Площадь лесов в европейских странах в 2005 г.*
- Европейский центральный банк / European Central Bank:  
[www.ecb.int/home/html/index.en.html](http://www.ecb.int/home/html/index.en.html)

## Данные по отдельным странам

Мы не стремились перечислить здесь как можно больше ресурсов, относящиеся к статистике отдельных стран. В сети можно найти достаточно много списков ссылок на национальные статистические органы. Достаточно провести интернет-поиск по фразе "statistical agencies" (в кавычках). Ниже приведен пример такого списка (составлен японским Бюро статистики).

Чаще всего заглавная страница статистического агентства страны создана на соответствующем государственном языке. Английский вариант сайта обычно можно найти по надписи «English». Названия на национальных языках мы привели только для тех стран, в которых используется латиница. К сожалению, далеко не для всех стран бесплатно доступные данные такие же богатые, как для США (данные по США и России мы выделили в отдельные разделы, см. ниже).

- Ссылки на национальные статистические агентства от Бюро статистики Японии / Links to Statistical Agencies:  
[www.stat.go.jp/english/info/148.htm](http://www.stat.go.jp/english/info/148.htm)
- Австралия / Australian Bureau of Statistics:  
[www.abs.gov.au](http://www.abs.gov.au)  
*[National Accounts] → [Australian National Accounts: State Accounts] → [Downloads] → Table 11. Agricultural Income, All States: Current prices [.xls] ⇒ Государственные счета системы национальных счетов Австралии, сельскохозяйственный доход по всем штатам за 1990-2008 гг. по годам.*
- Канада / Canadian economy online:  
[www.canadianeconomy.gc.ca](http://www.canadianeconomy.gc.ca)
- Чехия / Český statistický úřad / Czech Statistical Office:  
[www.czso.cz](http://www.czso.cz)

- Германия / Statistisches Bundesamt Deutschland / Germany – Federal Statistical Office:  
[www.destatis.de](http://www.destatis.de)
- Эстония / Eesti Statistika / Statistics Estonia:  
[www.stat.ee](http://www.stat.ee)
- Финляндия / Tilastokeskus – Statistikcentralen / Statistics Finland:  
[www.tilastokeskus.fi](http://www.tilastokeskus.fi)
- Израиль / Israel – The Central Bureau of Statistics:  
[cbs.gov.il](http://cbs.gov.il)
- Япония / Japan – Statistics Bureau:  
[www.stat.go.jp/english](http://www.stat.go.jp/english)
- Норвегия / Statistisk sentralbyrå / Statistics Norway:  
[www.ssb.no](http://www.ssb.no)
- Польша / Główny Urząd Statystyczny / Central Statistical Office of Poland:  
[www.stat.gov.pl](http://www.stat.gov.pl)
- Турция / Türkiye İstatistik Kurumu / Turkish Statistical Institute:  
[www.tuik.gov.tr](http://www.tuik.gov.tr)
- Статистика от Банка Англии / Bank of England – Statistics:  
[www.bankofengland.co.uk/statistics](http://www.bankofengland.co.uk/statistics)
- Экономические данные по Великобритании от Статистического агентства этой страны / UK Statistics Authority (Office for National Statistics):  
[www.statistics.gov.uk](http://www.statistics.gov.uk)  
[www.statistics.gov.uk/default.asp](http://www.statistics.gov.uk/default.asp)  
Те же данные на сайте Biz/ed / Biz/ed – Office for National Statistics (ONS) Data:  
[www.bized.co.uk/dataserv/ons/onshome.htm](http://www.bized.co.uk/dataserv/ons/onshome.htm)
- Нидерланды / Centraal Bureau voor de Statistiek (CBS) / Statistics Netherlands:  
[www.cbs.nl](http://www.cbs.nl)  
*[English] → Themes [Construction and housing] → [Figures] → [Dwellings; permit issued; completed] ⇒ Статистика строительства жилья в целом и по регионам за 2000-2008 гг. по годам.*
- Исследовательский центр ИПМ, исследования, прогнозы, мониторинг, Беларусь, Минск – Статистические данные:  
[www.research.by/rus/data](http://www.research.by/rus/data)

## Российские данные

Основными поставщиками российских макроэкономических данных являются государственные или окологосударственные структуры. Бесплатная статистика не такая обширная, как в США, но в последнее время Федеральная служба государственной статистики существенно расширила перечень данных, доступных через ее официальный сайт.

- Центральный Банк РФ:  
[www.cbr.ru](http://www.cbr.ru)  
*[Статистика] → [Денежно-кредитная и финансовая статистика] → Денежная масса: 2000 г. [Получить] ⇒ Денежная масса M0 и M2 в 2000 году ежемесячно.*

- Федеральная служба государственной статистики (бывший Госкомстат):  
[www.gks.ru](http://www.gks.ru)
- Экономическая экспертная группа:  
[www.eeg.ru](http://www.eeg.ru)
- Статистическая база данных по российской экономике ИИР ГУ-ВШЭ (Центр Анализа Данных):  
[stat.hse.ru](http://stat.hse.ru)
- Макроэкономика России, США, Еврозоны, Великобритании (инвестиции, инфляция, безработица, ВВП, финансы) – Агентство экономической информации ПРАЙМ-ТАСС:  
[e3.prime-tass.ru/macro](http://e3.prime-tass.ru/macro)
- Аграрная российская информационная система:  
[www.aris.ru](http://www.aris.ru)
- Панельное обследование российских домохозяйств от университета штата Северная Каролина / University of North Carolina (UNC) – Carolina Population Center – Russia Longitudinal Monitoring Survey:  
[www.cpc.unc.edu/rlms](http://www.cpc.unc.edu/rlms)

Главный источник российских финансовых данных – база Финам. Полезными могут оказаться также сайты РБК, агентства АК&М и фондовых бирж ММВБ и РТС.

- Финам:  
[www.finam.ru](http://www.finam.ru)
- Портал РБК:  
[www.rbc.ru](http://www.rbc.ru)  
[www.quote.ru](http://www.quote.ru)
- Агентство АК&М:  
[www.akm.ru](http://www.akm.ru)
- Московская межбанковская валютная биржа (ММВБ):  
[www.micex.ru](http://www.micex.ru)
- Биржа РТС:  
[www.rts.ru](http://www.rts.ru)
- Котировки ценных бумаг от Cbonds.Ru:  
[www.cbonds.info/all/rus/quotes](http://www.cbonds.info/all/rus/quotes)

## Данные по США

Мы выделили эти ссылки в специальный раздел, поскольку свободно доступных данных много.

- Сайт FedStats объединяет официальную информацию множества агентств Федерального правительства США:  
[www.fedstats.gov](http://www.fedstats.gov)
- Информационная система министерства сельского хозяйства США / U.S. Department of Agriculture – Economics, Statistics and Market Information System (ESMIS):  
[usda.mannlib.cornell.edu](http://usda.mannlib.cornell.edu)

- Бюро переписи населения США / U.S. Census Bureau:  
[www.census.gov](http://www.census.gov)
- Бюро трудовой статистики США / U.S. Bureau of Labor Statistics:  
[stats.bls.gov](http://stats.bls.gov)
- Бюро транспортной статистики США / Research and Innovative Technology Administration (RITA) – Bureau of Transportation Statistics:  
[www.bts.gov](http://www.bts.gov)
- База данных FRED от ФРС США / Federal Reserve Economic Data (FRED):  
[research.stlouisfed.org/fred2](http://research.stlouisfed.org/fred2)
- Американские и международные данные от Бюро экономического анализа США / U.S. Bureau of Economic Analysis (BEA):  
[www.bea.gov](http://www.bea.gov)
- Данные Национального бюро экономических исследований / National Bureau of Economic Research (NBER) – Data:  
[www.nber.org/data](http://www.nber.org/data)
- Экономический отчет президента США / Economic Report of the President:  
[www.gpoaccess.gov/eop](http://www.gpoaccess.gov/eop)
- Администрация энергетической информации предоставляет официальную энергетическую статистику правительства США / Energy Information Administration (EIA):  
[www.eia.doe.gov](http://www.eia.doe.gov)
- Отчеты о преступности Федерального бюро расследований США (ФБР) / Federal Bureau of Investigation – Uniform Crime Reports:  
[www.fbi.gov/ucr/ucr.htm](http://www.fbi.gov/ucr/ucr.htm)
- Информация от Совета управляющих Федеральной резервной системы США (ФРС) / Federal Reserve Board (FRB) – Economic Research & Data:  
[www.federalreserve.gov/econresdata/default.htm](http://www.federalreserve.gov/econresdata/default.htm)
- Национальный центр статистики здравоохранения / National Center for Health Statistics (NCHS):  
[www.cdc.gov/nchs](http://www.cdc.gov/nchs)
- Панельное исследование динамики доходов Мичиганского университета / University of Michigan – Panel Study of Income Dynamics (PSID):  
[psidonline.isr.umich.edu](http://psidonline.isr.umich.edu)
- Статистика по налогам и доходам Налогового управления США / Internal Revenue Service – Tax Statistics:  
[www.irs.gov/taxstats](http://www.irs.gov/taxstats)
- Служба STAT-USA/Internet Министерства торговли США предоставляет различную экономическую информацию федерального правительства / U.S. Department of Commerce – STAT-USA/Internet:  
[www.stat-usa.gov](http://www.stat-usa.gov)
- База данных о состоянии крупных городов / State of the Cities Data System (SOCDS):  
[socds.huduser.org](http://socds.huduser.org)



- Торговая статистика США в базе данных TradeStats Express Министерство торговли / U.S. Department of Commerce – TradeStats Express:  
[tse.export.gov](http://tse.export.gov)

### Данные, использованные в учебниках

Во многих учебниках и монографиях по эконометрике имеются учебные эмпирические примеры и упражнения. Если раньше такой учебник обычно сопровождал компьютерный диск с данными и, возможно, программами, сейчас такая информация размещается на веб-сайте учебника. Вот некоторые из них (см. также обзоры самих учебников в Анатольев, 2007, 2008):

- *Econometrics*, 4-е издание, автор Badi H. Baltagi:  
[www.springer.com/economics/econometrics/book/978-3-540-76515-8](http://www.springer.com/economics/econometrics/book/978-3-540-76515-8)
- *Econometric Analysis of Panel Data*, 3-е издание, автор Badi H. Baltagi:  
[www.wiley.com/legacy/wileychi/baltagi3e/data\\_sets.html](http://www.wiley.com/legacy/wileychi/baltagi3e/data_sets.html)
- *The Practice of Econometrics*, автор Ernst R. Berndt:  
[www.stanford.edu/~clint/berndt](http://www.stanford.edu/~clint/berndt)  
[shazam.econ.ubc.ca/student/berndt/data.htm](http://shazam.econ.ubc.ca/student/berndt/data.htm)
- *Microeconometrics: Methods and Applications*, авторы Colin Cameron & Pravin Trivedi:  
[cameron.econ.ucdavis.edu/mmabook/mmadata.html](http://cameron.econ.ucdavis.edu/mmabook/mmadata.html)
- *Econometric Theory and Methods*, авторы Russell Davidson & James G. MacKinnon:  
[www.econ.queensu.ca/ETM/data](http://www.econ.queensu.ca/ETM/data)
- *Introduction to Econometrics*, 3-е издание, автор Christopher Dougherty:  
[www.oup.com/uk/orc/bin/9780199280964/01student/datasets](http://www.oup.com/uk/orc/bin/9780199280964/01student/datasets)
- *Time Series Models for Business and Economic Forecasting*, автор Philip Hans Franses:  
[people.few.eur.nl/franses/research/data/tsa-data-2002.zip](http://people.few.eur.nl/franses/research/data/tsa-data-2002.zip)
- *Nonlinear Time Series Models in Empirical Finance*, авторы Philip Hans Franses & Dick van Dijk:  
[people.few.eur.nl/djvandijk/nltsmef/nltsmef.htm](http://people.few.eur.nl/djvandijk/nltsmef/nltsmef.htm)
- *Econometric Analysis*, 6-е издание, автор William Greene:  
[pages.stern.nyu.edu/~wgreene/Text/Edition6/tablelist6.htm](http://pages.stern.nyu.edu/~wgreene/Text/Edition6/tablelist6.htm)
- *Learning and Practicing Econometrics*, авторы William E. Griffiths, R. Carter Hill & George G. Judge:  
<ftp://ftp.wiley.com/public/college/economics/griffiths>
- *Time Series Analysis*, автор James D. Hamilton:  
[www.estima.com/Hamilton's\%20Time\%20Series\%20Analysis.shtml](http://www.estima.com/Hamilton's\%20Time\%20Series\%20Analysis.shtml)
- *Econometrics*, автор Fumio Hayashi:  
[fhayashi.fc2web.com/hayashi\\_econometrics.htm](http://fhayashi.fc2web.com/hayashi_econometrics.htm)
- *Principles of Econometrics*, 3-е издание, авторы R. Carter Hill, William E. Griffiths & Guay C. Lim:  
[bcs.wiley.com/he-bcs/Books?action=resource&bcsId=4137&itemId=0471723606&resourceId=12080](http://bcs.wiley.com/he-bcs/Books?action=resource&bcsId=4137&itemId=0471723606&resourceId=12080)

- *Theory and Practice of Econometrics*, 2-е издание, авторы George G. Judge, William E. Griffiths, R. Carter Hill, Helmut Lütkepohl & Tsoung-Chao Lee:  
<ftp://ftp.wiley.com/public/college/economics/hill>
- *State-Space Models with Regime-Switching*, авторы Chang-Jin Kim & Charles R. Nelson:  
[www.econ.washington.edu/user/cnelson/markov/prgmlist.htm](http://www.econ.washington.edu/user/cnelson/markov/prgmlist.htm)
- *Applied Time Series Econometrics*, редакторы Helmut Lütkepohl & Markus Krätzig:  
[www.jmulti.de/data\\_atse.html](http://www.jmulti.de/data_atse.html)
- *Introduction to Econometrics*, 3-е издание, автор G. S. Maddala:  
[www.wiley.co.uk/maddala/datasets.html](http://www.wiley.co.uk/maddala/datasets.html)
- *The Econometric Modelling of Financial Time Series*, 3-е издание, авторы Terence C. Mills & Raphael N. Markellos:  
[www.lboro.ac.uk/departments/ec/cup](http://www.lboro.ac.uk/departments/ec/cup)
- *Basic Econometrics*, 4-е издание, автор Damodar Gujarati:  
[gretl.sourceforge.net/gujarati/index.html](http://gretl.sourceforge.net/gujarati/index.html)  
3-е издание:  
[shazam.econ.ubc.ca/student/gujarati](http://shazam.econ.ubc.ca/student/gujarati)
- *Econometrics: A Modern Introduction*, автор Michael P. Murray:  
[wps.aw.com/aw\\_murray\\_economtrcs\\_1/37/9551/2445250.cw/index.html](http://wps.aw.com/aw_murray_economtrcs_1/37/9551/2445250.cw/index.html)
- *An Introduction to Classical Econometric Theory*, автор Paul Ruud:  
[elsa.berkeley.edu/~ruud/cet/data.html](http://elsa.berkeley.edu/~ruud/cet/data.html)
- *Introduction to Econometrics*, авторы James H. Stock & Mark W. Watson:  
[wps.aw.com/aw\\_stock\\_ie\\_2/50/13016/3332253.cw/index.html](http://wps.aw.com/aw_stock_ie_2/50/13016/3332253.cw/index.html)
- *Using Econometrics: A Practical Guide*, 5-е издание, автор A. H. Studenmund:  
[wps.aw.com/aw\\_studenmund\\_useecon\\_5/34/8912/2281679.cw/index.html](http://wps.aw.com/aw_studenmund_useecon_5/34/8912/2281679.cw/index.html)
- *Analysis of Financial Time Series*, автор Ruey S. Tsay:  
[faculty.chicagobooth.edu/ruey.tsay/teaching/fts](http://faculty.chicagobooth.edu/ruey.tsay/teaching/fts)
- *A Guide to Modern Econometrics*, автор Marno Verbeek:  
[www.econ.kuleuven.be/gme/data.htm](http://www.econ.kuleuven.be/gme/data.htm)
- *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*, автор Jeffrey Wooldridge:  
[www.msu.edu/~ec/faculty/wooldridge/book2.htm](http://www.msu.edu/~ec/faculty/wooldridge/book2.htm)
- *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 4-е издание, автор Jeffrey Wooldridge:  
[websites.swlearning.com/cgi-wadsworth/course\\_products\\_wp.pl?fid=M20bI&product\\_isbn\\_issn=9780324581621&discipline\\_number=413](http://websites.swlearning.com/cgi-wadsworth/course_products_wp.pl?fid=M20bI&product_isbn_issn=9780324581621&discipline_number=413)

## Данные, использованные в исследованиях

Некоторые известные эконометристы размещают на своих сайтах данные, которые использовали в своих статьях, иногда вместе со своими статьями. Вот ссылки на некоторых из них:

- Данные из статей Брюса Хансена (Университет Висконсина в Мэдисоне):  
[www.ssc.wisc.edu/~bhansen/progs/progs.htm](http://www.ssc.wisc.edu/~bhansen/progs/progs.htm)

- Данные из статей Марка Уотсона (Принстонский университет):  
[www.princeton.edu/~mwatson/publi.html](http://www.princeton.edu/~mwatson/publi.html)
- Данные из статей Джеймса Гамильтона (Университет Калифорнии в Сан-Диего):  
[weber.ucsd.edu/~jhamilto/software.htm](http://weber.ucsd.edu/~jhamilto/software.htm)
- Данные по доходностям и структурным сдвигам от Кеннета Френча (Дартмаутский Колледж):  
[mba.tuck.dartmouth.edu/pages/faculty/ken.french/data\\_library.html](http://mba.tuck.dartmouth.edu/pages/faculty/ken.french/data_library.html)
- Данные по доходностям акций от Уильяма Шверта (Рочестерский университет):  
[schwert.ssb.rochester.edu/data.htm](http://schwert.ssb.rochester.edu/data.htm)
- Макроэкономические данные в реальном времени от Нормана Свансона (Университет Рутгерс):  
[econweb.rutgers.edu/nswanson/realtime.htm](http://econweb.rutgers.edu/nswanson/realtime.htm)
- Макроэкономические временные ряды от Мэнфреда Гартнера:  
[www.fgn.unisg.ch/eumacro/macrodta/dmtrxneu.htm](http://www.fgn.unisg.ch/eumacro/macrodta/dmtrxneu.htm)
- Сверхвысокочастотные финансовые временные ряды от Роберта Энгеля:  
[weber.ucsd.edu/~mbacci/engle/index\\_data.html](http://weber.ucsd.edu/~mbacci/engle/index_data.html)
- Данные из статей и монографий Дэвида Хэндри:  
[www.nuff.ox.ac.uk/users/hendry/hendry.html#data](http://www.nuff.ox.ac.uk/users/hendry/hendry.html#data)

Некоторые журналы с сильной эмпирической направленностью требуют от авторов доступности данных (а иногда и программ). Благодаря этому появляется возможность повторить расчеты авторов и проверить их корректность. Таких журналов, впрочем, немного.

- Архив данных в *Journal of Applied Econometrics*:  
[qed.econ.queensu.ca/jae](http://qed.econ.queensu.ca/jae)
- Архив данных (FTP) в *Journal of Business and Economic Statistics*:  
[ftp://www.amstat.org/JBES\\_View](ftp://www.amstat.org/JBES_View)
- Архив данных в *Journal of Money, Credit, and Banking*:  
[web.econ.ohio-state.edu/jmcb/IndexDataArchive.php](http://web.econ.ohio-state.edu/jmcb/IndexDataArchive.php)

### Онлайновые данные из различных источников

- Экономические временные ряды от Economagic.com:  
[www.economagic.com](http://www.economagic.com)
- Бесплатные данные FreeLunch от Moody's Analytics:  
[www.economy.com/freelunch/default.asp](http://www.economy.com/freelunch/default.asp)
- Образовательный сайт Biz/ed:  
[www.bized.co.uk/dataserv/datahome.htm](http://www.bized.co.uk/dataserv/datahome.htm)
- Микро-данные и временные ряды от Economics Web Institute:  
[www.economicwebinstitute.org/ecdata.htm](http://www.economicwebinstitute.org/ecdata.htm)
- Библиотека временных рядов от Роба Хайндмана / Time Series Data Library:  
[www.robjhyndman.com/TSDL](http://www.robjhyndman.com/TSDL)
- Данные по M-competition (соревнование моделей прогнозирования):  
[www.neural-forecasting.com/m-competitions.htm](http://www.neural-forecasting.com/m-competitions.htm)

## Другие подборки данных и ссылок на данные

- Региональные экономические данные от EconData.Net:  
[econdata.net](http://econdata.net)
- Статистические данные по общественным наукам от Калифорнийского университета в Сан-Диего:  
[3stages.org/idata](http://3stages.org/idata)
- Перечень ссылок портала Econometric Links:  
[www.feweb.vu.nl/econometriclinks/#data](http://www.feweb.vu.nl/econometriclinks/#data)
- Перечень ссылок портала Quantitative Macroeconomics and Real Business Cycle:  
[dge.repec.org/data.html](http://dge.repec.org/data.html)
- Проект межотраслевого прогнозирования INFORUM от Мэрилендского университета:  
[inforumweb.umd.edu](http://inforumweb.umd.edu)
- Ссылки на данные по переходным экономикам от CERGE-EI:  
[home.cerge-ei.cz/hanousek/transition\\_data](http://home.cerge-ei.cz/hanousek/transition_data)
- Ссылки на статистические ресурсы по России, Восточной Европе и Центральной Азии от университета штата Мичиган / Online Statistical Resources for Russia, Eastern Europe and Central Asia – Michigan State University:  
[staff.lib.msu.edu/ticklet/staff/statistics.htm](http://staff.lib.msu.edu/ticklet/staff/statistics.htm)
- Ссылки от Эконометрической лаборатории Калифорнийского университета в Беркли / Econometrics Laboratory at the University of California, Berkeley:  
[elsa.berkeley.edu/eml/emldata.shtml](http://elsa.berkeley.edu/eml/emldata.shtml)
- Поисковик экономических ресурсов от Федерального резервного банка г. Сент-Луис / St. Louis Fed – Economic Resource Finder:  
[research.stlouisfed.org/research-links.html](http://research.stlouisfed.org/research-links.html)
- Ссылки на данные на сайте Resources for Economists on the Internet (RFE):  
[rfe.org/showCat.php?cat\\_id=2](http://rfe.org/showCat.php?cat_id=2)
- Статистические данные в Сети от библиотеки Мичиганского университета / University of Michigan Library – Statistical Resources on the Web:  
[www.lib.umich.edu/govdocs/statsnew.html](http://www.lib.umich.edu/govdocs/statsnew.html)
- Ссылки на экономические данные на сайте WebEc:  
[www.helsinki.fi/WebEc/framec8d.html](http://www.helsinki.fi/WebEc/framec8d.html)
- Ссылки на данные по международным отношениям от Пола Хенсела / International Relations Data Site:  
[www.paulhensel.org/data.html](http://www.paulhensel.org/data.html)

## Список литературы

Анатольев, С. (2007). Обзор англоязычных учебников по эконометрике. *Квантиль* 3, 73–82.

Анатольев, С. (2008). Обзор англоязычных учебников по анализу временных рядов. *Квантиль* 5, 49–55.

## Where to find data on the Web?

**Stanislav Anatolyev**

*New Economic School, Moscow, Russia*

**Alexander Tsyplakov**

*Novosibirsk State University, Novosibirsk, Russia*

We give thematically arranged lists of useful websites where an empirical economist can find data for research.

