

ПРЕДИСЛОВИЕ

В этот сборник вошли пересмотренные тексты наиболее важных докладов, сделанных на Втором Европейском статистическом семинаре «Вероятность, временные ряды и их приложения в эконометрике и других областях», который проходил в декабре 1994 г. в Нуффилд Колледже, Оксфорд. Европейский семинар по статистике имеет своей целью представить молодым талантливым исследователям возможность за короткое время ознакомиться с современным состоянием знаний и исследований по наиболее актуальным вопросам. Поэтому тексты, вошедшие в этот выпуск (равно как и в предыдущий, посвященный первому семинару этой серии, тема которого была «Сети и хаос: статистический и вероятностный аспекты»), носят учебный характер. В семинаре участвовало 35 молодых специалистов по статистике из десяти стран Европы. Почти все участники сделали короткие сообщения о своих последних работах. Несмотря на высокое качество этих докладов, включить их в этот выпуск не представилось возможным.¹⁾

В работе Шепарда (N. G. Shephard) дан обзор и продолжено исследование одного класса нелинейных моделей временных рядов, которые широко используются в эконометрике и представляют потенциальный интерес для других областей. Работа Йохансена (S. Johansen) представляет собой очень доступно написанное изложение понятия коинтеграции, которое важно в вопросах интерпретации многомерных нестационарных временных рядов. Клеменс (M. P. Clements) и Хендри (D. F. Hendry) обсуждают общие вопросы статистики предсказания ошибок. Проблематика этих трех работ непосредственно связана с задачами эконометрики. Методы, которые были целью Йенсена (B. A. Jensen) и Нильсена (J. A. Nielsen), начиная с азов, излагаются математические основы расчета опционов, а также другие вопросы математической теории финансов.

Barndorff-Nielsen O. E., Cox D. R. and Hinkley D. V. Preface. — В кн.: Time Series Models in Econometrics, Finance and Other Fields, p. xiii-xiv. Publisher: Chapman & Hall, 1996 г.

© Авторизованный перевод на русский язык с сокращениями. Научное издательство «ТВП», 1996 г.

¹⁾ Из-за ограниченности объема выпусков нашего журнала и выбранной тематики данного выпуска статья N. M. Laird «Longitudinal Panel Data: An Overview of Current Methodology», менее отвечающая этой тематике, в русском переводе не публикуется. — *Прим. редакции.*

В организационный комитет Второго Общеввропейского семинара по статистике вошли: Барндорф-Нильсен (Университет Орхуса), Кокс, Хинкли (Оксфорд), Кендалл (Варвикский университет), Шепард (Нуффилд Колледж, Оксфорд) и Лоуз (Оксфорд) (О. Е. Barndorff-Nielsen, Aarhus University; D. R. Cox и D. V. Hinkley, Oxford; W. S. Kendall, University of Warwick; N. G. Shephard, Nuffield College, Oxford; и C. N. Laws, Oxford). Запланированы следующие сессии семинара. Третий семинар пройдет в 1996 г. в Тулузе и будет посвящен стохастической геометрии.

Второй Общеввропейский семинар по статистике проводился при поддержке Европейского Сообщества (фонд евроконференций ЕСМ), за что мы выражаем искреннюю признательность.

От имени организаторов семинара,
О. Е. Барндорф-Нильсен, Д. Р. Кокс, Д. В. Хинкли
(Орхус; Оксфорд).

От редакции. Научное издательство «ТВП» глубоко признательно издательству Chapman & Hall, предоставившему права на публикацию переводов четырех статей из книги «Модели теории временных рядов в задачах эконометрики, финансов и в других областях», что стало возможным благодаря любезному содействию г-жи А. Биштига (Mrs A. Bisztyga).

Одновременно редакция приносит читателям свои извинения за задержку выхода в свет последнего выпуска 1996 г. в связи с тем, что права на публикацию этих переводов были получены лишь в начале 1997 года.