

нометрично моделиране, поне за по-широката целева аудитория, са софтуерните продукти от втората група. Те дават възможности за препрограмиране на съществуващи и програмиране на нови иконометрични методи и процедури. Въпреки че *Shazam*, *Soritec*, *RATS* и пр. са относително полесни за овладяване и обучение в сравнение с *Gauss* и *Matlab*, то техните възможности би трябвало да се използват предимно за разширяване на съществуващите (вградените) методи и организиране на итеративна обработка. Иконометричните софтуерни продукти от трета и четвърта група използват стандартен интерфейс и се разглеждат подробно по-нататък в статията във връзка с новите иконометрични процедури и информационното осигуряване.

През последните десет години иконометричната теория и емпиричните изследвания се развиват преимуществено в областта на коинтеграцията¹, оценяването чрез обобщения метод на моментите (GMM)², нелинейното оценяване³ и други (Hamilton, 1994; Mills, 1999). За целите на иконометричното моделиране най-често се използват VAR⁴ модели, обобщени авторегресионни модели с условен хетероскедастицитет (GARCH)⁵, модели на коригираната грешка (VECM)⁶ и др. Още по-ясно се очертават тенденциите в развитието на иконометричната теория и емпиричните изследвания при прегледа на периодичните научни публикации. Например при тематично изследване чрез *EBSCO Publishing*⁷ се установиха ясни тенденции на увеличаване на интереса към коинтеграцията, нелинейното оценяване и пр. За периода след 1995 г. относителният дял на иконометричните публикации в областта на коинтеграцията се е увеличил близо 40 пъти, изследванията за интегрираност⁸ са се увеличили над 20 пъти, изследванията чрез моделите VAR - 4 пъти, изследванията чрез моделите GARCH - 3 пъти, изследванията в областта на GMM - 2 пъти,

¹ Поради това, че цитираните иконометрични термини са сравнително нови и нямат все още подходящи или утвърдени преводи на български език, много от тях се споменават на английски език. В случая Cointegration.

² Generalized Method of Moments.

³ Estimation of nonlinear.

⁴ Vector Autoregressions.

⁵ Generalized Autoregressive Conditional Heteroskedasticity.

⁶ Vector Error Correction Models.

⁷ *EBSCO Publishing* е агрегираща информационна система, чрез която се обобщават периодични публикации от над 4000 научни списания, вестници и пр., включително *Econometrica*, *Journal of Econometrics*, *Journal of Applied Econometrics*, *American Statistician*, *European Economic Review* и др. Изследването обхваща два периода - до 1995 г. и след 1995 г. По-подробно вж. <http://search.epnet.com>. За ползването на информационната система е необходим оторизиран достъп.

⁸ Изследвания за единичен корен (Unit Root).