

Научно-практический журнал
Прикладная
ЭКОНОМЕТРИКА



№ 36(4) 2014

ISSN 1993-7601

Главный редактор

Айвазян Сергей Артемьевич — д-р физ.-мат. наук, акад. (иностранн. член) НАН Армении, Центральный экономико-математический институт РАН (ЦЭМИ РАН), Московский финансово-промышленный университет «Синергия», Высшая школа экономики (НИУ ВШЭ), Московская школа экономики МГУ.

Заместитель главного редактора

Пересецкий Анатолий Абрамович — д-р экон. наук, НИУ ВШЭ, ЦЭМИ РАН, Российская экономическая школа (РЭШ).

Ответственный секретарь

Сластников Александр Дмитриевич — канд. физ.-мат. наук, ЦЭМИ РАН.

Члены редколлегии

Бродский Б. Е. — д-р физ.-мат. наук, ЦЭМИ РАН, НИУ ВШЭ.

Ван Суст А. — Ph. D., Тилбургский университет, Нидерланды.

Вербик М. — Ph. D., школа менеджмента, Роттердам, Нидерланды.

Денисова И. А. — Ph. D., Центр экономических и финансовых исследований и разработок (ЦЭФИР), ЦЭМИ РАН.

Елисеева И. И. — чл.-кор. РАН, д-р экон. наук, Социологический институт РАН, Санкт-Петербургский университет экономики и финансов.

Канторович Г. Г. — канд. физ.-мат. наук, НИУ ВШЭ.

Карлеваро Ф. — д-р наук, Женевский университет, Швейцария.

Макаров В. Л. — акад. РАН, д-р физ.-мат. наук, ЦЭМИ РАН, РЭШ.

Максимов А. Г. — канд. физ.-мат. наук, Нижегородский филиал НИУ ВШЭ.

Микушева А. Е. — Ph. D., канд. физ.-мат. наук, Массачусетский технологический институт, Кэмбридж, США.

Мхитарян В. С. — д-р экон. наук, НИУ ВШЭ.

Рубин Ю. Б. — д-р экон. наук, профессор, чл.-кор. РАО, ректор МФПУ «Синергия».

Рудзкис Р. — д-р наук, Институт математики и информатики, Каунасский университет, Литва.

Слуцкий Л. Н. — Ph. D., Институт экономики РАН.

Суслов В. И. — чл.-кор. РАН, д-р экон. наук, Институт экономики и организации промышленного производства СО РАН.

Харин Ю. С. — чл.-кор. НАН Беларуси, д-р физ.-мат. наук, Белорусский государственный университет, НИИ прикладных проблем математики и информатики БГУ, Беларусь.

Журнал «Прикладная эконометрика» включен в список периодических изданий ВАК, рекомендованных для публикации результатов диссертационных исследований. Он также индексируется в международных базах научных журналов по экономике RePEc и EconLit.

МАКРОЭКОНОМИКА**А. Г. Шульгин**

Сколько правил монетарной политики необходимо
при оценке DSGE модели для России? 3

С. А. Айвазян, А. Н. Березняцкий, Б. Е. Бродский

«Голландская болезнь» в экономиках России и Армении 32

ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ**В. В. Лакшина**

Можно ли снять «проклятие размерности»?
Пространственные спецификации многомерных моделей волатильности 61

Б. А. Путко, А. С. Диденко, М. М. Дубовиков

Модель волатильности обменного курса валют (RUR/USD),
построенная на основе фрактальных характеристик финансового ряда 79

ИННОВАЦИИ**М. Ю. Архипова, Е. А. Александрова**

Исследование характера связи инновационной и экспортной активности
российских предприятий 88

ОБЩЕСТВО**М. В. Лещайкина**

Межстрановой эконометрический анализ
социальной комфортности проживания населения 102

ОБРАЗОВАНИЕ**О. В. Польшин, В. А. Силаева, А. М. Силаев**

Сравнение приема на образовательные программы в вузе
по результатам олимпиад и баллов ЕГЭ 118

Новые книги 133

Памяти Эмиля Борисовича Ершова 134

Current issue 136

Abstracts 137

Авторы 139

Содержание журнала за 2014 г. 140

№ 33 (1) 2014

МАКРОЭКОНОМИКА**А. В. Полбин**

Эконометрическая оценка структурной макроэкономической модели российской экономики 3

ИНВЕСТИЦИИ**В. Ф. Лапо**Эконометрическое исследование эффективности методов стимулирования инвестиций
в лесопромышленный комплекс 30**ЭКОНОМИКА ТРУДА****П. В. Травкин**Оценка отдачи от дополнительного профессионального обучения российских работников:
учет влияния способностей на заработную плату 51**ОБЩЕСТВО****Д. В. Сальникова**Моделирование взаимосвязи между субъективным экономическим благополучием граждан
и поддержкой институтов социального государства в странах ЕС 71**ТЕОРИЯ И МЕТОДОЛОГИЯ****А. И. Балаев**Копула на основе многомерного t -распределения с вектором степеней свободы 90**В. К. Семёнычев, Е. И. Куркин, Е. В. Семёнычев, А. А. Данилова**

Инструментарий моделирования колебательной компоненты в колоколообразных кривых жизненного цикла продукта . . 111

КЛАССИЧЕСКИЕ РАБОТЫ ПО ЭКОНОМЕТРИКЕ**А. Е. Микушева**

Стандартные ошибки в форме Ньюи–Веста 124

Уитни К. Ньюи, Кеннет Д. ВестПростая, положительно полуопределенная оценка асимптотической матрицы ковариаций,
состоятельная при наличии гетероскедастичности и автокорреляции 125**НАУЧНАЯ ЖИЗНЬ**

X Международная научная конференция

«Применение многомерного статистического анализа в экономике и оценке качества» 133

№ 34 (2) 2014

ТЕОРИЯ И МЕТОДОЛОГИЯ**С. А. Айвазян, М. Ю. Афанасьев, В. А. Руденко**Исследование зависимости случайных составляющих
стохастической производственной функции при оценке технической эффективности 3**РЕГИОНЫ****О. А. Демидова**Пространственно-авторегрессионная модель для двух групп взаимосвязанных регионов
(на примере восточной и западной части России) 19**ПОТРЕБЛЕНИЕ****Tolga Omay, Mub̄ariz Hasanov, Nuri Uçar**

Energy consumption and economic growth: Evidence from nonlinear panel cointegration and causality tests 36

ЭКОНОМИКА ТРУДА**А. В. Аистов, Е. А. Александрова**Оценки индивидуальной отдачи от дополнительного профессионального обучения —
пример промышленного предприятия 56**ОБРАЗОВАНИЕ****Д. Р. Валеева, О. В. Польшин, М. М. Юдкевич**

Социальные связи студента и выбор специализации 80

ОБЩЕСТВО**Л. С. Засимова, Е. В. Коссова, М. Д. Рязанова**

Социально-экономические факторы, влияющие на отношение индивидов к запрету на курение в общественных местах . . 95

ФОНДОВЫЕ РЫНКИ**А. В. Щерба**

Сравнение моделей реализованной волатильности на примере оценки меры риска VaR для российского рынка акций . . . 120

НАУЧНАЯ ЖИЗНЬ

Сергею Артемьевичу Айвазяну — 80 лет . . . 137

№ 35 (3) 2014**ФИНАНСЫ****А. М. Лозинская, Е. М. Ожегов**

Оценка кредитного риска при ипотечном жилищном кредитовании . . . 3

Г. И. Пеникас

Иерархические копулы в моделировании рисков инвестиционного портфеля . . . 18

ФОНДОВЫЕ РЫНКИ**Р. И. Дурдыев, А. А. Пересецкий**

Автокорреляция в глобальном стохастическом тренде . . . 39

ЦЕНООБРАЗОВАНИЕ**К. В. Житков, Т. А. Ратникова**

Построение гедонистических ценовых индексов на полотна художников-фовистов . . . 59

ЭКОНОМИКА ТРУДА**К. К. Фурманов, И. А. Шелковникова**

Безработные и экономически неактивные — в чем различия? Моделирование вероятности трудоустройства . . . 86

Е. В. Семерикова

Безработица в Западной и Восточной Германии: пространственный анализ панельных данных . . . 107

НАУЧНАЯ ЖИЗНЬ

Предстоящие конференции по эконометрике и прикладной статистике . . . 133

Азиатско-Тихоокеанская конференция по продуктивности . . . 135

№ 36 (4) 2014**МАКРОЭКОНОМИКА****А. Г. Шульгин**

Сколько правил монетарной политики необходимо при оценке DSGE модели для России? . . . 3

С. А. Айвазян, А. Н. Березняцкий, Б. Е. Бродский

«Голландская болезнь» в экономиках России и Армении . . . 32

ФИНАНСОВЫЕ РЫНКИ**В. В. Лакшина**

Можно ли снять «проклятие размерности»?

Пространственные спецификации многомерных моделей волатильности . . . 61

Б. А. Путко, А. С. Диденко, М. М. Дубовиков

Модель волатильности обменного курса валют (RUR/USD),

построенная на основе фрактальных характеристик финансового ряда . . . 79

ИННОВАЦИИ**М. Ю. Архипова, Е. А. Александрова**

Исследование характера связи инновационной и экспортной активности российских предприятий . . . 88

ОБЩЕСТВО**М. В. Лещайкина**

Межстрановой эконометрический анализ социальной комфортности проживания населения . . . 102

ОБРАЗОВАНИЕ**О. В. Польшин, В. А. Силаева, А. М. Силаев**

Сравнение приема на образовательные программы в вузе по результатам олимпиад и баллов ЕГЭ . . . 118

Новые книги . . . 133

Памяти Эмиля Борисовича Ершова . . . 134

№ 33 (1) 2014

MACROECONOMICS*Andrey Polbin*

Econometric estimation of a structural macroeconomic model for the Russian economy 3

INVESTMENTS*Valentina Lapo*

Efficiency of investment stimulation methods in a timber industry complex: An econometric research 30

LABOR*Pavel Travkin*

The impact of the on-the-job training on Russian worker's salary: The effect of abilities approach 51

SOCIETY*Daria Salnikova*

Modeling the relationship between subjective economic well-being of citizens and their support for the welfare state institutions in the EU member countries. 71

THEORY AND METHODOLOGY*Alexey Balaev*The copula based on multivariate *t*-distribution with vector of degrees of freedom 90*Valery Semenichev, Evgeni Kurkin, Evgeni Semenichev, Anastasia Danilova*

Oscillatory components in the bell-shaped curves of the product life cycle modeling tool. 111

SEMINAL PAPERS IN ECONOMETRICS*Anna Mikusheva*

Newey–West standard errors 124

Whitney K. Newey and Kenneth D. West

A simple, positive semi-definite, heteroskedasticity and autocorrelation consistent covariance matrix 125

SCIENTIFIC LIFE

X International Conference

«Multidimensional Statistics Analysis Application in Economics and Quality Control» 133

№ 34 (2) 2014

THEORY AND METHODOLOGY*Sergei Aivazian, Mikhail Afanasiev, Victoria Rudenko*

Analysis of dependence between the random components of a stochastic production function for the purpose of technical efficiency estimation. 3

REGIONS*Olga Demidova*

Spatial-autoregressive model for the two groups of related regions (eastern and western parts of Russia). 19

CONSUMPTION*Tolga Omay, Mub̄ariz Hasanov, Nuri Uçar*

Energy consumption and economic growth: Evidence from nonlinear panel cointegration and causality tests 36

LABOR*Andrey Aistov, Ekaterina Aleksandrova*

Individual returns to training: Evidence from Russian firm 56

EDUCATION*Dilyara Valeeva, Oleg Poldin, Maria Yudkevich*

Student's social ties and the choice of specialization 80

SOCIETY*Liudmila Zasimova, Elena Kossova, Marina Ryazanova*

Understanding individual attitudes towards ban on smoking in public places 95

STOCK MARKETS*Alexandr Shcherba*

Comparing «Realized volatility» models in the VaR calculation for the Russian equity market 120

SCIENTIFIC LIFE80th anniversary of Sergei Aivazian 137

№ 35 (3) 2014

FINANCE

Agatha Lozinskaya, Evgeniy Ozhegov

Estimation of mortgage lending credit risk 3

Henry Penikas

Investment portfolio risk modelling based on hierarchical copulas 18

STOCK MARKETS

Ruslan Durdyev, Anatoly Peresetsky

Autocorrelation in the global stochastic trend 39

PRICING

Konstantin Zhitkov, Tatiana Ratnikova

The construction of hedonic price indices for fauvists' paintings 59

LABOR

*Kirill Furmanov, Irina Shelkovnikova*Unemployed and out of the labor force:
What is the difference? Modeling the probability of finding a job 86*Elena Semerikova*

Unemployment in East and West Germany: Spatial panel data analysis 107

SCIENTIFIC LIFE

Forthcoming conferences on econometrics and applied statistics 133

The 2014 Asia-Pacific productivity conference 135

№ 36 (4) 2014

MACROECONOMICS

Andrei Shulgin

How much monetary policy rules do we need to estimate DSGE model for Russia? 3

Sergei Aivazian, Alexander Bereznyatskiy, Boris Brodsky

Dutch disease in Russian and Armenian economies 32

FINANCIAL MARKETS

*Valeriya Lakshina*Is it possible to break the «curse of dimensionality»?
Spatial specifications of multivariate volatility models 61*Boris Putko, Alexander Didenko, Mikhail Dubovikov*The model of volatility of the exchange rate (RUR/USD),
based on the fractal characteristics of time series 79

INNOVATIONS

Marina Arkhipova, Elena Aleksandrova

Study of the relationship between innovation and export activity of Russian firms 88

SOCIETY

Marina Leshchaykina

Econometric cross-country analysis of the living population social comfort 102

EDUCATION

*Oleg Poldin, Vera Silaeva, Andrey Silaev*Comparing quality of admission to universities by the results of olympiads
and unified state exams scores 118

New books 133

In memory 134

ПОДПИСКА-2015

Журнал «Прикладная эконометрика» выходит 4 раза в год:
Март Июнь Сентябрь Декабрь

Вы можете выбрать любой удобный для Вас вид подписки:

Подписка через редакцию

Стоимость подписки на 2015 год:

3 месяца	6 месяцев	9 месяцев	Годовая
1220 руб.	2440 руб.	3660 руб.	4880 руб.

Подписку можно оформить с любого месяца.

Тел./факс: (495) 663-93-88 (доб. 1839)

Подписка на почте

По каталогу агентства «Роспечать»

индекс 20496

По объединенному каталогу «Пресса России»

индекс 88058

Доставка осуществляется заказной бандеролью с уведомлением.

Руководитель службы маркетинга: Я. И. Орлов

тел.: (495) 663-93-88 (доб. 1839, 1845), e-mail: yorlov@s-university.ru

Приобрести электронную версию журнала «Прикладная эконометрика»,
полностью или отдельные публикации, можно на сайтах
www.applieconometrics.ru и www.elibrary.ru

К оплате принимаются все виды электронных платежей,
возможна также оплата банковскими картами и с помощью SMS.

Учредитель и издатель НОУ ВПО «МФПУ «Синергия»
Свидетельство о регистрации ПИ № ФС 77-57884 от 25.04.2014 г.
Выдано Федеральной службой по надзору в сфере связи,
информационных технологий и массовых коммуникаций (Роскомнадзор)

Редакция:

Заведующая редакцией **Е. Н. Соколова**

Литературный редактор **Н. В. Разевиг**

Верстка, дизайн макета **Б. В. Зипунов**

Адрес редакции и издателя:

129090, Москва, ул. Мещанская, д. 9/14, стр.1 (юр.)
125190, Россия, Москва, Ленинградский просп., д. 80, корп. Г, офис 620
Тел.: (495) 663-93-88 (доб. 1839)
E-mail: edit@s-university.ru
www.applieconometrics.ru,
<http://applieconometrics.cemi.rssi.ru>

Наши реквизиты:

НОУ ВПО «МФПУ «Синергия»
ИНН 7729152149
КПП 770201001
ОГРН 1037700232558
Р/с 40703810538040005410
Сбербанк России (ОАО) Тверское ОСБ №9038/01764
к/с 30101810400000000225
БИК 044525225

При перепечатке и цитировании материалов ссылка на журнал «Прикладная эконометрика» обязательна.
Редакция не несет ответственности за достоверность информации, опубликованной в рекламных объявлениях.
Мнения авторов и редакции могут не совпадать.

© НОУ ВПО «МФПУ «Синергия»

Подписано в печать: 04.12.2014

Тираж 1000 экз.

Отпечатано в ООО «САМ ПОЛИГРАФИСТ»
129090, г. Москва, Протопоповский пер., д.6