

Научно-практический журнал

Прикладная

ЭКОНОМЕТРИКА



№ 4(12) 2008

ISSN 1993-7601

БАНКИ

Г. И. Пеникас

Прогнозирование кривой доходности в задачах управления активами и пассивами банка 3

МАКРОЭКОНОМИКА

Е. А. Рожковская

Эконометрическая модель анализа и прогнозирования элементов конечного потребления Республики Беларусь: концептуальные и методические подходы, результаты расчетов 27

РЕГИОНЫ

Анна Вайнберг Аллен

Графы для анализа структурных соотношений между переменными и их приложение к изучению российских регионов (часть 2) 42

ТЕОРИЯ И МЕТОДОЛОГИЯ

Э. Б. Ершов

Выбор регрессии, максимизирующий несмещенную оценку коэффициента детерминации 71

КОНСУЛЬТАЦИИ

Деан Фантаццини

Управление кредитным риском 84

CONTENTS 138

ABSTRACTS 139

СВЕДЕНИЯ ОБ АВТОРАХ 140

В 2006 году журнал Прикладная эконометрика включен в список периодических изданий ВАК, рекомендованных для публикации результатов диссертационных исследований.

Главный редактор

Айвазян Сергей Артемьевич — д-р физ.-мат. наук, профессор, заслуженный деятель науки России, зам. директора Центрального экономико-математического института РАН (ЦЭМИ РАН), зав. кафедрой эконометрики Московской финансово-промышленной академии (МФПА).

Заместитель главного редактора

Слуцкин Лев Наумович — Ph.D. по математике, научный сотрудник Института экономики РАН (ИЭ РАН).

Ответственный секретарь

Славова Виктория Валерьевна — канд. физ.-мат. наук, доцент МГУ.

Члены редколлегии

Бродский Б. Е. — д-р физ.-мат. наук, зав. Ситуационным центром ЦЭМИ РАН, профессор Государственного университета — Высшей школы экономики (ГУ ВШЭ).

Денисова И. А. — Ph.D. по экономике, ведущий экономист Центра экономических и финансовых исследований и разработок (ЦЭФИР), научный сотрудник ЦЭМИ РАН.

Елисеева И. И. — чл.-корр. РАН, зав. кафедрой статистики и эконометрики Санкт-Петербургского университета экономики и финансов.

Ершов Э. Б. — канд. экон. наук, ординарный профессор ГУ ВШЭ.

Иванова С. С. — канд. экон. наук, главный специалист управления исследований и бизнес-аналитики банка «Русский Стандарт».

Канторович Г. Г. — проректор ГУ-ВШЭ, профессор, зав. кафедрой математической экономики и эконометрики ГУ ВШЭ.

Карлеваро Фабрицио (Швейцария) — доктор наук, ординарный профессор кафедры эконометрики Женевского университета.

Макаров В. Л. — академик РАН, директор ЦЭМИ РАН, президент Российской экономической школы.

Максимов А. Г. — канд. физ.-мат. наук, первый заместитель директора Нижегородского филиала ГУ ВШЭ.

Мхитарян В. С. — д-р экон. наук, профессор, зав. кафедрой прикладной статистики МФПА, зав. кафедрой статистических методов ГУ ВШЭ.

Рубин Ю. Б. — д-р экон. наук, профессор, ректор МФПА.

Рудзкис Римантас (Литва) — доктор наук, зав. отделом Института математики и информатики Литвы, профессор Каунасского университета.

Суслов В. И. — чл.-корр. РАН, д-р экон. наук, профессор, зам. директора Института экономики и организации промышленного производства СО РАН.

Харин Ю. С. (Республика Беларусь) — чл.-корр. Национальной академии наук Беларуси, д-р физ.-мат. наук, профессор Белорусского государственного университета, зав. кафедрой математического моделирования и анализа данных БГУ.