

Научно-практический журнал
Прикладная
ЭКОНОМЕТРИКА



№3(7) 2007

ISSN 1993-7601



Market DS

БАНКИ***Г. М. Гамбаров***

Показатель структурной ликвидности как индикатор процентной политики 3

А. С. Чижкова

Эконометрическая модель оценки матриц вероятностей переходов кредитных рейтингов 11

РЫНКИ ЦЕННЫХ БУМАГ***С. Ю. Титов***

Адаптивная система принятия решений на финансовых рынках 27

Е. Ю. Щетинин, К. М. Назаренко

Модель распределений вероятностных смесей экстремальных величин 44

МАКРОЭКОНОМИКА***В. А. Колемаев***

О последствиях инвестирования в производство дополнительного дохода, порожденного ростом мировых цен на энергоресурсы и сырье 53

ОБЩЕСТВО***С. В. Арженовский, Д. В. Артамонова***

Оценка потерь в зарплате женщин с детьми 66

К. В. Кетова

Экономико-математическая модель потенциала трудовых ресурсов и стоимостных характеристик демографических потерь 80

О. И. Шкараташ, Г. А. Ястребов

Выделение реальных (гомогенных) социальных групп в российском обществе: методы и результаты 95

КОНСУЛЬТАЦИИ***Л. Н. Слуцкин***

Обобщенный метод моментов 119

CONTENT 134**ABSTRACTS** 135**СВЕДЕНИЯ ОБ АВТОРАХ** 137

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

Главный редактор

Айвазян Сергей Артемьевич — д. физ.-мат. н., 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

Слуцкий Лев Наумович — Ph.D по математике, доцент МФПА.

Члены редколлегии

Бродский Б. Е. — д. физ.-мат. н., 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. — к. э. н., ординарный профессор ГУ-ВШЭ.

Иванова С. С. — к. э. н., главный специалист управления исследования 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, зав. кафедрой эконометрики Женевского университета.

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

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

Мхитарян В. С. — д. э. н., профессор, зав. кафедрой прикладной статистики МФПА, директор Института статистики и эконометрики Московского государственного университета экономики, статистики и информатики.

Рубин Ю. Б. — д. э. н., 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. э. н., профессор, зам. директора Института экономики и организации промышленного производства СО РАН.

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