

Научно-практический журнал

Прикладная

ЭКОНОМЕТРИКА



№ 1 (13) 2009

ISSN 1993-7601

БАНКИ

Г. И. Пеникас, В. Б. Симакова

Управление процентным риском на основе копулы-GARCH моделей 3

ИНВЕСТИЦИИ

Е. А. Тесля, Н. П. Алексеева, П. В. Грачева

Исследование влияния эндогенных характеристик российских топливно-энергетических и металлургических компаний на совокупность параметров их международного финансирования 37

МАКРОЭКОНОМИКА

А. Г. Багдоев, С. В. Варданын, Д. Р. Карапетян, Г. А. Мартиросян

Аналитические и численные исследования динамических процессов в экономике методами волновой динамики 50

Л. Е. Варшавский

Моделирование динамики цены на нефть при разных режимах развития рынка нефти 70

ИНФЛЯЦИЯ

Л. Н. Слуцкин

Статистический анализ инфляционных процессов в промышленных секторах американской экономики, 1959–1996 гг. 89

КОНСУЛЬТАЦИИ

Деан Фантаццини

Управление кредитным риском (продолжение) 105

CONTENTS 140

ABSTRACTS 141

СВЕДЕНИЯ ОБ АВТОРАХ 142

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 — Высшая школа 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.