

Научно-практический журнал

# Прикладная

## ЭКОНОМЕТРИКА

№ 4 (8) 2007

ISSN 1993-7601



**РЫНКИ ЦЕННЫХ БУМАГ**

**О. Л. Крицкий, М. К. Ульянова**

Определение многомерного финансового риска портфеля акций ..... 3

**О. В. Стихова**

Вычисление характеристик стационарных случайных последовательностей экстремальных величин ..... 18

**МИКРОЭКОНОМИКА**

**С. А. Айвазян, М. Ю. Афанасьев**

Оценка мероприятий, направленных на управление факторами неэффективности производства ..... 27

**РОССИЙСКО-ШВЕЙЦАРСКИЙ СЕМИНАР ПО ЭКОНОМЕТРИКЕ И СТАТИСТИКЕ**

Вступительное слово главного редактора ..... 42

Программа семинара ..... 43

**Gérard Antille**

Descriptive Analysis of Matrix-Valued Time-Series ..... 45

**Gérard Antille, Anna Weinberg Allen**

D-optimal Design for Polynomial Regression: Choice of Degree and Robustness ..... 55

**Gabrielle Antille Gaillard**

Equity and Health ..... 67

**Fabrizio Carlevaro, C. Schlessner, M. E. Binet, S. Durand, M. Paul**

Econometric Modeling and Analysis of Residential Water Demand Based on Unbalanced Panel Data ..... 81

**Cristian Gonzalez**

Alternative Methodologies for Social Assessment of Environmental Projects ..... 103

**КОНСУЛЬТАЦИИ**

**М. Вербик**

Авторегрессионная условная гетероскедастичность (АРУГ) ..... 125

**CONTENT** ..... 133

**ABSTRACTS** ..... 134

**СВЕДЕНИЯ ОБ АВТОРАХ** ..... 136

**СОДЕРЖАНИЕ ЖУРНАЛА ЗА 2007 ГОД** ..... 139

**CONTENT OF 2007** ..... 141

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**

**Слуцкин 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 исследований и бизнес-аналитики банка «Русский Стандарт».

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

**Карлеварио 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.** — к. физ.-мат. н., первый заместитель директора Нижегородского филиала ГУ-ВШЭ.

**Мхитарян В. С.** — д. э. н., профессор, зав. кафедрой прикладной статистики МФПА, зав. кафедрой 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 Беларуси, д. физ.-мат. н., профессор Белорусского государственного университета, зав. кафедрой математического моделирования и анализа данных БГУ.