

Научно-практический журнал **Прикладная** **ЭКОНОМЕТРИКА**



2017, т. 48

Главный редактор

Айвазян Сергей Артемьевич — д-р физ.-мат. наук, акад. (иностранный член) НАН Армении, Центральный экономико-математический институт РАН (ЦЭМИ РАН); 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

Аистов А. В. — канд. физ.-мат. наук, Нижегородский филиал НИУ ВШЭ.

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

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.

Ениколопов Р. — Ph. D., Университет Помпеу Фабра, Барселона, Испания; РЭШ.

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

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

Кумбхакар С. — Ph. D., Университет штата Нью-Йорк в Бингемтоне, США.

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, Кембридж, 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 индексируется в международных базах научных журналов по экономике RePEc и EconLit, а также в Russian Science Citation Index (RSCI) на платформе Web of Science.

*E*Applied CONOMETRICS



2017, vol. 48

Editor-in-Chief

Sergey Aivazian — Central Economics and Mathematics Institute (CEMI RAS), Moscow; National Research University Higher School of Economics (NRU HSE); Moscow School of Economics (MSE), Moscow.

Vice-Editor

Anatoly Peresetsky — National Research University Higher School of Economics (NRU HSE); Central Economics and Mathematics Institute (CEMI RAS); New Economic School (NES), Moscow.

Executive Editor

Alexander Slastnikov — Central Economics and Mathematics Institute (CEMI RAS), Moscow.

Associate Editors

Andrey Aistov — National Research University Higher School of Economics (NRU HSE) branch in Nizhny Novgorod.

Boris Brodsky — Central Economics and Mathematics Institute (CEMI RAS), Moscow.

Fabrizio Carlevaro — University of Geneva, Geneva (Switzerland).

Irina Denisova — Centre for Economic and Financial Research (CEFIR); Central Economics and Mathematics Institute (CEMI RAS), Moscow.

Irina Eliseeva — Sociological Institute (SI RAS); Saint-Petersburg State University of Economics and Finance, Saint-Petersburg.

Ruben Enikolopov — Universitat Pompeu Fabra, Barcelona (Spain); New Economic School (NES), Moscow.

Grigoriy Kantorovich — National Research University Higher School of Economics (NRU HSE), Moscow.

Yury Kharin — Belarusian State University; Research Institute for Applied Problems of Mathematics and Informatics, Minsk (Belarus).

Subal Kumbhakar — State University of New York, Binghamton (USA).

Valery Makarov — Central Economics and Mathematics Institute (CEMI RAS); New Economic School (NES), Moscow.

Andrey Maksimov — National Research University Higher School of Economics (NRU HSE) branch in Nizhny Novgorod.

Anna Mikusheva — Massachusetts Institute of Technology, Cambridge (USA).

Vladimir Mkhitarian — National Research University Higher School of Economics (NRU HSE), Moscow.

Yury Rubin — Sinergia Moscow University of Industry and Finance, Moscow.

Rimantas Rudzkis — Institute of Mathematics and Informatics, Vilnius (Lithuania).

Lev Slutskin — Institute of Economics (IE RAS), Moscow.

Arthur van Soest — Tilburg University, Tilburg (Netherlands).

Viktor Suslov — Institute of Economics and Industrial Engineering of the Siberian Branch of RAS, Novosibirsk.

Marno Verbeek — Rotterdam School of Management, Rotterdam (Netherlands).

Applied Econometrics is indexed in RePEc (Research Papers in Economics), EconLit (The American Economic Association's electronic bibliography) and RSCI (Russian Science Citation Index) on Web of Science.

ИНТЕГРАЦИЯ РЫНКОВ*К. П. Глущенко*

Рынок Москвы в экономическом пространстве страны 5

КРЕДИТОВАНИЕ*Е. В. Румянцева, К. К. Фурманов*Реализация ипотечного имущества:
анализ с помощью моделей времени жизни. 22**ЭМПИРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ И АНОНИМНОСТЬ ДАННЫХ***Т. Komarova, D. Nekipelov,**A. Al Rafi, E. Yakovlev*

K-anonymity: A note on the trade-off between data utility and data security 44

ФОНДОВЫЕ РЫНКИ*А. Д. Аганин*Сравнение GARCH и HAR-RV моделей
для прогноза реализованной волатильности на российском рынке 63**ДОМОХОЗЯЙСТВА***Л. И. Ниворожкина*Текущие доходы и финансовое поведение домохозяйств:
кто в кризис теряет больше? 85**НАРОДОНАСЕЛЕНИЕ***В. В. Андреев, В. Ю. Лукиянова, Е. Н. Кадышев*Анализ территориального распределения населения в субъектах
Приволжского федерального округа с применением законов Ципфа и Гибрата 97**ТЕОРИЯ И МЕТОДОЛОГИЯ.****АГЕНТ-ОРИЕНТИРОВАННЫЙ ПОДХОД К МОДЕЛИРОВАНИЮ***В. Л. Макаров, А. Р. Бахтизин,**Е. Д. Сушко, А. Ф. Агеева*Имитация социально-экономической системы Евразийского континента
с помощью агент-ориентированных моделей 122

Содержание журнала за 2017 год 140

MARKET INTEGRATION

Konstantin Gluschenko

The Moscow market in the country's economic space 5

MORTGAGE

Ekaterina Rumyantseva, Kirill Furmanov

Realisation of mortgage property: Survival analysis 22

EMPIRICAL ANALYSIS AND ANONYMITY

*Tatiana Komarova, Denis Nekipelov,
Ahnaf Al Rafi, Evgeny Yakovlev*

K-anonymity: A note on the trade-off between data utility and data security 44

STOCK MARKETS

Artem Aganin

Forecast comparison of volatility models on Russian stock market 63

HOUSEHOLDS

Ludmila Nivorozhkina

Current incomes and financial behavior of households:

Who loses more in a crisis? 85

POPULATION

Vsevolod Andreev, Violetta Lukiyanova, Evgenii Kadyshev

Analysis of people territorial distribution in regions

of the Volga Federal District on the base of Zipf and Gibrat laws 97

THEORY AND METHODOLOGY.

AGENT-BASED APPROACH TO MODELING

*Valerii Makarov, Albert Bakhtizin,
Elena Sushko, Alina Ageeva*

Simulation of the socio-economic system

of the Eurasian continent using the agent-based models 122

Contents of 2017 140