

Экономический журнал ВШЭ. 2017. Т. 22. № 3. С. 329.
HSE Economic Journal, 2017, vol. 22, no 3, p. 329.

Математическое моделирование экономики

Данный номер журнала представляет серию статей российских авторов по математическому моделированию экономики, посвященных оригинальным подходам к широкому кругу проблем этой науки.

Статья А.А. Жуковой и И.Г. Поспелова носит в основном теоретический характер и посвящена решению классической задачи оптимизации дисконтированной полезности потребителя, но в условиях, когда покупка продукта и взятие потребительского кредита происходят в случайные, неизвестные агенту заранее моменты времени. Эта задача оказывается исключительно сложной. Условия оптимальности сводятся к уравнениям в частных производных с переменными и неизвестными запаздываниями. Успеха удастся добиться только сочетанием тонких асимптотических разложений с численными методами.

Остальные статьи носят более прикладной характер.

Статья С.Б. Васильева, И.П. Станкевича, А.А. Ужегова представляет новый подход к проблеме агрегирования данных межотраслевого баланса. Актуальность этой проблемы связана с тем, что в силу стремительного роста номенклатуры продукции и процессов глобализации классическая линейная модель В.В. Леонтьева стала терять адекватность, о чем не раз говорил, увы, покойный Э.Б. Ершов.

Статьи А.В. Леонидова, В.А. Нечитайло, Е.Е. Серебряниковой и Н.П. Пильника, С.А. Радионова, А.А. Языкова посвящены описанию функционирования российской банковской системы, но если в первой представлена имитационная агентная модель, то во второй банковская система описывается как единый рационально действующий агент.

Авторы всех моделей, кроме первой, большое внимание уделяют вопросам идентификации своих моделей. В частности, статья С.М. Иващенко специально посвящена анализу источников ошибок идентификации популярных в настоящее время линеаризованных около сбалансированного роста динамических стохастических моделей общего равновесия.

И.Г. Поспелов,

член-корреспондент РАН,
приглашенный редактор специального выпуска
Экономического журнала ВШЭ