

НАУЧНАЯ *НК* КНИГА

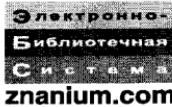


Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации

И.Я. Лукасевич
Е.А. Федорова

**ПРОГНОЗИРОВАНИЕ
ФИНАНСОВЫХ КРИЗИСОВ:
МЕТОДЫ, МОДЕЛИ,
ИНДИКАТОРЫ**

Монография



Москва
ВУЗОВСКИЙ УЧЕБНИК
ИНФРА-М
2015

ОГЛАВЛЕНИЕ

ВВЕДЕНИЕ.....	3
Глава 1.	
Разработка кризисных индикаторов на основе пробит-моделирования	5
1.1. Прогнозирование финансовых кризисов с помощью кризисных индикаторов	5
1.2. Особенности протекания кризисов в странах СНГ	7
1.3. Основные подходы к определению кризисных периодов и кризисных индикаторов	11
1.4. Методы определения комплексных кризисных индикаторов	16
1.5. Оценка кризисных индикаторов для стран СНГ	19
Глава 2.	
Индикаторы кризисных ситуаций для стран СНГ на основе методологии Маркова	34
2.1. Прогнозирование экономических кризисов: ретроспектива и современные подходы	34
2.2. Методология исследования и выбор потенциальных кризисных индикаторов	39
2.3. Анализ результатов моделирования и тестирования значимости фундаментальных факторов для стран СНГ	51
2.4. Построение системы комплексных прогностических кризисных индикаторов для России	60
Глава 3.	
Кризисные индикаторы для денежно-кредитной политики регулятора	78
3.1. Разработка финансовых индикаторов для регулирования денежно-кредитной политики	78
3.2. Разработка индекса финансовой устойчивости (FCI) для прогнозирования финансовых кризисов в Российской Федерации	81
3.3. Определение границ индексов финансовой стабильности	98
ЗАКЛЮЧЕНИЕ.....	103
СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ	105
ПРИЛОЖЕНИЕ А.....	110
ПРИЛОЖЕНИЕ Б	116
ПРИЛОЖЕНИЕ В	123