

УДК 330.4(075.3)
ББК 65в6я73
С23

С23 Сборник задач по эконометрике: Учебное пособие для студентов экономических вузов / Сост. Е.Ю. Дорохина, Л.Ф. Преснякова, Н.П. Тихомиров. — М.: Издательство «Экзамен», 2003. — 224 с.

Рецензент: Н.С. Перекалина, доктор экономических наук.



Подготовлено при содействии Национального
Фонда Подготовки Кадров.

ISBN 5-94692-206-8

Сборник задач подготовлен по учебной дисциплине «Эконометрика». Базовыми учебниками, структура и содержание которых взяты за основу сборника, послужили: «Эконометрика» (Тихомиров Н.П., Дорохина Е.Ю., М.: Экзамен, 2003), «Прикладная статистика и основы эконометрики» (Айвазян С.А., Мхитарян В.С., М.: ЮНИТИ, 1998), «Эконометрические методы» (Джонстон Дж., М.: Статистика), «Econometric analysis» (Green W.H. Macmillan Publishing Company, №7, 2000).

В сборнике представлены такие темы, как «Проблемы построения эконометрической модели», «Методы оценки параметров линейных эконометрических моделей», «Линейные модели временных рядов», «Модели финансовой эконометрики» и др.

Предназначен для студентов экономико-математических специальностей.

Сборник может оказаться полезным аспирантам и преподавателям, а также руководителям и специалистам предприятий, особенно при прогнозировании и принятии стратегических решений.

УДК 330.4(075.3)
ББК 65в6я73

ISBN 5-94692-206-8

© Дорохина Е.Ю., Преснякова Л.Ф., Тихомиров Н.П., 2003
© Российская Экономическая Академия, 2003
© Издательство «ЭКЗАМЕН», 2003

Оглавление

ГЛАВА 1. ПРОБЛЕМЫ ПОСТРОЕНИЯ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОЙ МОДЕЛИ	4
ГЛАВА 2. МЕТОДЫ ОЦЕНКИ ПАРАМЕТРОВ ЛИНЕЙНЫХ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ	16
ГЛАВА 3. МЕТОДЫ ОЦЕНКИ КОЭФФИЦИЕНТОВ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОЙ МОДЕЛИ С НЕСТАНДАРТНЫМИ ОШИБКАМИ.....	69
ГЛАВА 4. ПОСТРОЕНИЕ МОДЕЛЕЙ В УСЛОВИЯХ МУЛЬТИКОЛЛИНЕАРНОСТИ НЕЗАВИСИМЫХ ПЕРЕМЕННЫХ	108
ГЛАВА 5. МОДЕЛИ С ЛАГОВЫМИ ЗАВИСИМЫМИ ПЕРЕМЕННЫМИ.....	124
ГЛАВА 6. ЛИНЕЙНЫЕ МОДЕЛИ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ	133
ГЛАВА 7. МОДЕЛИ ФИНАНСОВОЙ ЭКОНОМЕТРИКИ.....	153
ГЛАВА 8. СИСТЕМЫ ВЗАИМОЗАВИСИМЫХ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ	163
ГЛАВА 9. ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ С ПЕРЕМЕННОЙ СТРУКТУРОЙ	174
ГЛАВА 10. ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ СО СПЕЦИФИЧЕСКИМИ ПЕРЕМЕННЫМИ	182
ГЛАВА 11. МЕТОДЫ ОЦЕНКИ ПАРАМЕТРОВ НЕЛИНЕЙНЫХ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ	197
ГЛАВА 12. ИСПОЛЬЗОВАНИЕ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ В ПРОГНОЗИРОВАНИИ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ	209
ЛИТЕРАТУРА	222