

# ОГЛАВЛЕНИЕ

|  |            |
|--|------------|
| Предисловие .....  | 3          |
| <b>Глава 1. Определение эконометрики .....</b>                                       | <b>7</b>   |
| 1.1. Предмет эконометрики .....  | 7          |
| 1.2. Особенности эконометрического метода .....                                      | 14         |
| 1.3. Измерения в экономике .....   | 25         |
| Контрольные вопросы .....  | 32         |
| <b>Глава 2. Парная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях .....</b> | <b>34</b>  |
| 2.1. Спецификация модели .....   | 34         |
| 2.2. Линейная регрессия и корреляция: смысл и оценка параметров .....                | 41         |
| 2.3. Оценка существенности параметров линейной регрессии и корреляции .....          | 48         |
| 2.4. Интервалы прогноза по линейному уравнению регрессии .....                       | 57         |
| 2.5. Нелинейная регрессия .....  | 62         |
| 2.6. Корреляция для нелинейной регрессии .....                                       | 80         |
| 2.7. Средняя ошибка аппроксимации .....  | 87         |
| Контрольные вопросы .....  | 88         |
| <b>Глава 3. Множественная регрессия и корреляция .....</b>                           | <b>90</b>  |
| 3.1. Спецификация модели .....   | 90         |
| 3.2. Отбор факторов при построении множественной регрессии .....                     | 92         |
| 3.3. Выбор формы уравнения регрессии .....   | 100        |
| 3.4. Оценка параметров уравнения множественной регрессии .....                       | 105        |
| 3.5. Частные уравнения регрессии .....   | 109        |
| 3.6. Множественная корреляция .....  | 112        |
| 3.7. Частная корреляция .....  | 121        |
| 3.8. Оценка надежности результатов множественной регрессии и корреляции .....        | 129        |
| 3.9. Фиктивные переменные во множественной регрессии .....                           | 141        |
| 3.10. Предпосылки метода наименьших квадратов .....                                  | 155        |
| 3.11. Обобщенный метод наименьших квадратов .....                                    | 169        |
| Контрольные вопросы .....  | 175        |
| <b>Глава 4. Системы эконометрических уравнений .....</b>                             | <b>177</b> |
| 4.1. Общее понятие о системах уравнений, используемых в эконометрике .....           | 177        |
| 4.2. Структурная и приведенная формы модели .....                                    | 181        |
|  | 341        |

|   |   |            |
|---|---|------------|
| 4.3.  | Проблема идентификации .....  | 185        |
| 4.4.  | Оценивание параметров структурной модели .....  | 193        |
| 4.5.  | Применение систем эконометрических уравнений ...                                      | 204        |
| 4.6.  | Путевой анализ .....  | 213        |
|   | Контрольные вопросы .....   | 225        |
| <b>Глава 5. Моделирование одномерных временных рядов .</b>  |   | <b>225</b> |
| 5.1.  | Основные элементы временного ряда .....   | 225        |
| 5.2.  | Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры .....                | 227        |
| 5.3.  | Моделирование тенденции временного ряда .....   | 234        |
| 5.4.  | Моделирование сезонных и циклических колебаний .                                      | 239        |
| 5.5.  | Моделирование тенденции временного ряда при наличии структурных изменений .....       | 255        |
|   | Контрольные вопросы .....   | 262        |
| <b>Глава 6. Изучение взаимосвязей по временным рядам ..</b> |   | <b>263</b> |
| 6.1.  | Специфика статистической оценки взаимосвязи двух временных рядов .....                | 263        |
| 6.2.  | Методы исключения тенденции .....   | 265        |
| 6.3.  | Автокорреляция в остатках. Критерий Дарбина – Уотсона .....                           | 272        |
| 6.4.  | Оценивание параметров уравнения регрессии при наличии автокорреляции в остатках ..... | 278        |
| 6.5.  | Коинтеграция временных рядов .....  | 282        |
|   | Контрольные вопросы .....   | 289        |
| <b>Глава 7. Динамические эконометрические модели .....</b>  |   | <b>290</b> |
| 7.1.  | Общая характеристика моделей с распределенным лагом и моделей авторегрессии .....     | 290        |
| 7.2.  | Интерпретация параметров моделей с распределенным лагом .....                         | 292        |
| 7.3.  | Изучение структуры лага и выбор вида модели с распределенным лагом .....              | 297        |
| 7.3.1.  | Лаги Алмон .....  | 298        |
| 7.3.2.  | Метод Койка .....   | 305        |
| 7.3.3.  | Метод главных компонент .....   | 310        |
| 7.4.  | Модели адаптивных ожиданий и неполной корректировки .....                             | 319        |
| 7.5.  | Оценка параметров моделей авторегрессии .....   | 325        |
| 7.6.  | Новые направления в анализе многомерных временных рядов .....                         | 330        |
|   | Контрольные вопросы .....   | 335        |
| <b>Литература .....</b>                                     |   | <b>337</b> |
| <b>Предметный указатель .....</b>                           |   | <b>338</b> |