

# ОГЛАВЛЕНИЕ

Предисловие научного редактора перевода .....	5
От автора .....	9
Введение .....	11
<b>Глава 1. Подбор объясняющих переменных для линейной модели . . .</b>	<b>15</b>
1.1. Вводные замечания .....	15
1.2. Исключение квазиинвариантных переменных .....	16
1.3. Вектор и матрица коэффициентов корреляции.....	19
1.4. Метод анализа матрицы коэффициентов корреляции .....	23
1.5. Метод показателей информационной емкости .....	28
1.6. Коэффициент множественной корреляции .....	33
1.7. Эффект катализа в эконометрической модели .....	37
<b>Глава 2. Оценивание параметров линейных моделей методом     наименьших квадратов .....</b>	<b>43</b>
2.1. Вводные замечания .....	43
2.2. Оценивание параметров модели с одной объясняющей переменной	44
2.3. Оценивание параметров модели с несколькими объясняющими переменными .....	52
<b>Глава 3. Верификация линейных моделей .....</b>	<b>60</b>
3.1. Вводные замечания .....	60
3.2. Оценивание соответствия модели эмпирическим данным .....	60
3.3. Исследование существенности структурных параметров.....	67
3.4. Определение относительного влияния объясняющих переменных на объясняемую переменную .....	71
<b>Глава 4. Нелинейные модели, сводимые к линейным .....</b>	<b>73</b>
4.1. Вводные замечания .....	73
4.2. Выбор аналитической формы модели на основе априорной информации об исследуемых зависимостях.....	73
4.3. Выбор аналитической формы модели на основе графиков разброса эмпирических точек .....	76
4.4. Подбор объясняющих переменных .....	82
4.5. Оценивание параметров.....	89
4.6. Исследование соответствия модели эмпирическим данным.....	96
<b>Глава 5. Исследование свойств случайных отклонений.....</b>	<b>100</b>
5.1. Вводные замечания .....	100
5.2. Исследование случайности .....	100
5.3. Исследование нормальности распределения .....	104
5.4. Исследование несмещенности.....	108
5.5. Исследование автокорреляции .....	111
5.6. Исследование стабильности дисперсии.....	116
<b>Глава 6. Некоторые специальные методы оценивания параметров     линейных моделей.....</b>	<b>122</b>
6.1. Вводные замечания .....	122
6.2. Обобщенный метод наименьших квадратов.....	122
6.3. Метод первых разностей .....	132
6.4. Метод инструментальных переменных.....	137
6.5. Метод максимального правдоподобия .....	142
<b>Глава 7. Последовательные процедуры построения модели.....</b>	<b>147</b>
7.1. Вводные замечания .....	147

7.2. Построение модели с коинциденцией .....	147
7.3. Процедура исключения <i>a posteriori</i> .....	154
7.4. Процедура пошаговой селекции .....	157
<b>Глава 8. Многомерные модели .....</b>	<b>162</b>
8.1. Вводные замечания .....	162
8.2. Структурная и приведенная формы модели .....	162
8.3. Классификация многомерных моделей .....	167
8.4. Оценивание параметров простых и рекуррентных моделей .....	170
8.5. Идентифицируемость моделей с взаимозависимыми уравнениями .....	178
8.6. Косвенный метод наименьших квадратов.....	182
8.7. Двухшаговый метод наименьших квадратов .....	191
<b>Глава 9. Эконометрическое прогнозирование .....</b>	<b>198</b>
9.1. Вводные замечания .....	198
9.2. Прогнозирование по трендам .....	198
9.3. Прогнозирование по описательной модели .....	203
9.4. Прогнозирование методом гармонических весов.....	209
<b>Статистические таблицы.....</b>	<b>216</b>
<b>Решения задач.....</b>	<b>230</b>
<b>Литература .....</b>	<b>242</b>

*Практикум охватывает все основные темы эконометрики. Каждая глава содержит методические указания, разбор типовых примеров и контрольные задания, к которым в конце книги даются ответы. Все изложение (с обилием числовых примеров) направлено на то, чтобы обеспечить понимание сущности каждой процедуры эконометрического анализа, моделирования и прогнозирования. Материал практикума не требует высокого уровня математической подготовки и соответствует российскому образовательному стандарту.*

*Для студентов и преподавателей экономических вузов и факультетов*