

ОГЛАВЛЕНИЕ

Предисловие	5
Глава 1. Предмет, методы и задачи эконометрики	7
1.1. Что такое эконометрика?	7
1.2. Специфика эконометрики в аграрной экономике	9
1.3. Связь эконометрики с экономической теорией, математикой и другими дисциплинами	11
Глава 2. Анализ рядов распределения	15
2.1. Значение рядов распределения для эконометрики	15
2.2. Виды рядов распределения	16
2.3. Анализ ранжированного ряда. Проверка близости распределения к нормальному закону.....	19
2.4. Анализ равноинтервального ряда	21
2.5. Анализ равночастотного ряда и показатели степени неравномерности распределения	25
Глава 3. Анализ и моделирование парной корреляционной связи	30
3.1. Сущность корреляционной связи и методы ее изучения	30
3.2. Основные задачи и условия применения корреляционно-регрессионного анализа и моделирования.....	39
3.3. Линейная регрессия и корреляция в экономике	44
3.4. Измерение тесноты связи и надежности ее установления	51
3.5. Криволинейная регрессия	58
Глава 4. Многофакторный корреляционно-регрессионный анализ и моделирование	67
4.1. Условия применения метода него ограничения	67
4.2. Выбор типа многофакторной модели и факторных признаков	71
4.3. Система показателей многофакторной корреляции и регрессии	74
4.4. Разложение коэффициента множественной детерминации на отдельные факторы и измерение их системного эффекта.....	84
4.5. Включение в многофакторную модель не количественных факторов	88
4.6. Применение многофакторных регрессионных моделей для анализа деятельности предприятий и прогнозирования	91
Глава 5. Системы эконометрических регрессионных уравнений	96
5.1. Понятие о системах регрессионных уравнений	96
5.2. Граф связей и система структурных уравнений	97
5.3. Математико-логический анализ проблемы решения системы взаимосвязанных уравнений	99
5.4. Приведенные уравнения.....	101
5.5. Идентификация системы уравнений	103
5.6. Рекуррентная система уравнений, методика ее решения	106
5.7. Решение точно идентифицируемой системы уравнений косвенным методом наименьших квадратов (КМНК).....	109
5.8. Решение сверхидентифицируемой системы уравнений	113
Глава 6. Анализ, моделирование и прогнозирование одномерного временного ряда	119
6.1. Основные этапы изучения, моделирования и прогнозирования рядов динамики	119
6.2. Методика проверки статистических гипотез о типе тренда	121
6.3. Оценка параметров экспоненциального, логарифмического и логистического уравнений тренда	124
6.4. Вероятностные оценки надежности параметров тренда	138
6.5. Авторегрессия и автокорреляция	146
6.6. Методы измерения устойчивости уровней ряда.....	157
6.7. Модели сезонной колеблемости.....	166
6.8. Прогнозирование одномерного ряда с учетом его тенденции и колеблемости	179

6.9. Вероятностная оценка показателей колеблемости	198
Глава 7. Анализ, моделирование и прогнозирование комплекса (системы) взаимосвязанных временных рядов	208
7.1. Жестко детерминированная система признаков	208
7.2. Анализ и моделирование связи между временными рядами	214
7.3. Измерение лага и корреляция рядов с учетом лага ____	222
7.4. Прогнозирование с учетом корреляции между рядами	227
Глава 8. Комплексные методы моделирования и прогнозирования ____	237
8.1. Метод включения параметра времени в факторную регрессионную модель	237
8.2. Агрегирование трендов и колебаний по совокупности объектов	241
<i>Приложения</i>	
1. Многократное скользящее выравнивание. Урожайность зерновых во Франции	249
2. Значение t -критерия Стьюдента при уровне значимости 0,5; 0,05; 0,01	251
3. Z-преобразование. Значение величины z для значений R	252
4. Критические значения коэффициентов корреляции для уровней значимости 0,05; 0,01.....	253
Литература.....	254

Рассматриваются системы экономических регрессионных уравнений, линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками, а также моделирование и прогнозирование временных рядов и комплексные методы моделирования и прогнозирования. Рассчитан на лиц, имеющих знания по общей теории статистики.

Для студентов, обучающихся в аграрных вузах для получения квалификации «Экономист», преподавателей и аспирантов экономических специальностей вузов.