

ОГЛАВЛЕНИЕ

<i>Введение</i>	3
Глава 1	
ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ АСПЕКТЫ	
ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОГО МОДЕЛИРОВАНИЯ	
1.1. Эконометрика как наука	5
1.2. Предмет эконометрики	7
1.3. Цели и задачи эконометрики	10
1.4. Критерии и принципы эконометрики	11
1.5. Основные этапы эконометрического моделирования	13
<i>Контрольные вопросы</i>	16
Глава 2	
ОСНОВЫ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОГО	
ПРОГНОЗИРОВАНИЯ В УСЛОВИЯХ РЫНКА	
2.1. Общее представление о стохастических и детерминированных процессах	16
2.2. Методы прогнозирования: интуитивный, формализованный	18
2.3. Основные эконометрические модели и их типы	20
2.4. Применение эконометрических моделей	23
<i>Контрольные вопросы</i>	25
Глава 3	
ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ	
ВОСПРОИЗВОДСТВЕННОГО ПРОЦЕССА	
3.1. Анализ производства и издержек	25
3.2. Типы производственных функций	27
3.3. Производственная функция Кобба — Дугласа	32
3.4. Функции издержек	34
3.5. Анализ спроса и предложения	35
3.6. Анализ инвестиций и основных фондов	38
<i>Контрольные вопросы</i>	39
Глава 4	
МЕТОДОЛОГИЯ ПОСТРОЕНИЯ	
ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ	
4.1. Организация процесса построения эконометрических моделей	40
4.2. Предварительная обработка данных	42
4.3. Спецификация эконометрических моделей	46
4.3.1. Методы отбора факторов при построении регрессионных моделей	51
4.3.2. Выбор формы уравнения множественной регрессии	53
<i>Контрольные вопросы</i>	55
Глава 5	
МЕТОДОЛОГИЯ ОЦЕНКИ ПАРАМЕТРОВ	
РЕГРЕССИОННЫХ УРАВНЕНИЙ	
5.1. Метод наименьших квадратов (МНК)	56
5.2. Фиктивные переменные	62
5.3. Предпосылки МНК	65
5.4. Мультиколлинеарность	73
5.5. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК)	77
<i>Контрольные вопросы</i>	82
Глава 6	
СТАТИСТИЧЕСКАЯ ОЦЕНКА РЕЗУЛЬТАТОВ	
ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОГО МОДЕЛИРОВАНИЯ	
6.1. Статистическая характеристика эконометрической модели	83
6.2. Идентификация парной линейной регрессионной модели	85
6.3. Статистическое изучение парной нелинейной регрессионной эконометрической модели	92

6.4. Оценка статистической корректности синтезированной модели множественной регрессии.....	97
6.5. Оценка адекватности модели	107
6.6. Методология прогнозирования по линейному уравнению регрессии	108
<i>Контрольные вопросы</i>	111

Глава 7

ИЗУЧЕНИЕ ВЗАИМОСВЯЗЕЙ, АНАЛИЗ И МОДЕЛИРОВАНИЕ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ ДАННЫХ

7.1. Классификация и компонентный анализ рядов динамики.....	112
7.2. Методология регрессионного анализа тенденции временного ряда.....	116
7.3. Моделирование сезонных и циклических колебаний временного ряда	126
7.4. Методы выявления периодической компоненты.....	132
7.5. Методы измерения устойчивости тенденций динамики.....	136
7.6. Моделирование тенденции ряда динамики при наличии структурных изменений	138
7.7. Регрессионный анализ связанных динамических рядов	144
7.7.1. Метод отклонений от тренда	149
7.7.2. Метод последовательных разностей.....	150
7.7.3.3. Метод включения в уравнение регрессии фактора времени	150
7.8. Оценивание параметров уравнения регрессии при наличии автокорреляции в остатках	151
7.9. Теория коинтеграции временных рядов.....	155
7.10. Корреляционный анализ временных рядов данных.....	157
7.11. Прогнозирование тенденции временного ряда	159
7.12. Характеристика классов динамических эконометрических моделей.....	162
7.13. Интерпретация параметров моделей с распределенным лагом.....	164
7.14. Выбор формы модели с распределенным лагом	166
7.15. Авторегрессионные модели	173
7.16. Оценка параметров моделей авторегрессии	177
7.17. Новые направления в анализе многомерных временных рядов.....	179
7.17.1. Модели векторной авторегрессии.....	179
7.17.2. Модели рациональных ожиданий	181
7.17.3. Коинтеграция временных рядов и механизм исправления ошибок	183
<i>Контрольные вопросы</i>	184

Глава 8 СИСТЕМЫ ОДНОВРЕМЕННЫХ УРАВНЕНИЙ

8.1. Необходимость использования систем уравнений	185
8.2. Составляющие и формы систем уравнений в эконометрических исследованиях	187
8.3. Смещенность и несостоятельность оценок МНК для систем одновременных уравнений.....	192
8.4. Проблема идентификации.....	195
8.5. Методология оценивания параметров систем уравнений.....	200
8.5.1. Косвенный метод наименьших квадратов (КМНК)	201
8.5.2. Двухшаговый метод наименьших квадратов (ДМНК).....	205
8.5.3. Трехшаговый метод наименьших квадратов (ТМНК)	208
8.6. Применение систем эконометрических уравнений	209
<i>Контрольные вопросы</i>	213

<i>Библиография</i>	215
---------------------------	-----

<i>Глоссарий</i>	216
------------------------	-----

<i>Приложение. Статистико-математические таблицы</i>	219
--	-----

