

СОДЕРЖАНИЕ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Раздел 1. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ.....	3
Раздел 2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	4
Раздел 3. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ.....	8

КУРС ЛЕКЦИЙ

Раздел 1. СТОХАСТИЧЕСКИЕ ПРОЦЕССЫ, ИСПОЛЬЗУЕМЫЕ ПРИ МОДЕЛИРОВАНИИ СЛУЧАЙНОЙ СОСТАВЛЯЮЩЕЙ ВРЕМЕННОГО РЯДА.....	12
ТЕМА 1. СТАЦИОНАРНЫЕ СТОХАСТИЧЕСКИЕ ПРОЦЕССЫ	12
ТЕМА 2. ПРОЦЕССЫ АВТОРЕГРЕССИИ И СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО	14
ТЕМА 3. АВТОКОРРЕЛЯЦИЯ И СПЕКТР.....	18
ТЕМА 4. ИНТЕГРИРУЕМЫЕ ПРОЦЕССЫ	23
ТЕМА 5. МОДЕЛИ АВТОРЕГРЕССИИ ПРОИНТЕГРИРОВАННОГО СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО	32
Раздел 2. СИСТЕМЫ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ УРАВНЕНИЙ	38
ТЕМА 6. ОБЩЕЕ ПОНЯТИЕ О СИСТЕМАХ УРАВНЕНИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ В ЭКОНОМЕТРИКЕ	38
ТЕМА 7. СТРУКТУРНАЯ И ПРИВЕДЕННАЯ ФОРМЫ МОДЕЛИ. ПРОБЛЕМА ИДЕНТИФИКАЦИИ	41
ТЕМА 8. ОЦЕНИВАНИЕ ПАРАМЕТРОВ СТРУКТУРНОЙ МОДЕЛИ.....	49
ТЕМА 9. ПРИМЕНЕНИЕ СИСТЕМ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ УРАВНЕНИЙ.....	54
Раздел 3. ДИНАМИЧЕСКИЕ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ	60
ТЕМА 10. ОБЩАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА МОДЕЛЕЙ С РАСПРЕДЕЛЕННЫМ ЛАГОМ И МОДЕЛЕЙ АВТОРЕГРЕССИИ	61
ТЕМА 11. ИНТЕРПРЕТАЦИЯ ПАРАМЕТРОВ МОДЕЛЕЙ С РАСПРЕДЕЛЕННЫМ ЛАГОМ И МОДЕЛЕЙ АВТОРЕГРЕССИИ	62
ТЕМА 12. ИЗУЧЕНИЕ СТРУКТУРЫ ЛАГА И ВЫБОР ВИДА МОДЕЛИ С РАСПРЕДЕЛЕННЫМ ЛАГОМ ...	65
ТЕМА 13. МОДЕЛИ АДАПТИВНЫХ ОЖИДАНИЙ И НЕПОЛНОЙ КОРРЕКТИРОВКИ.....	81
ТЕМА 14. ОЦЕНКА ПАРАМЕТРОВ МОДЕЛЕЙ АВТОРЕГРЕССИИ.....	86
ТЕМА 15. НОВЫЕ НАПРАВЛЕНИЯ В АНАЛИЗЕ МНОГОМЕРНЫХ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ.....	90
СЛОВАРЬ ТЕРМИНОВ	98
ПРИЛОЖЕНИЯ	ПО
МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ВЫПОЛНЕНИЮ КОНТРОЛЬНЫХ РАБОТ.....	123