

Герасимов А. Н.

**Эконометрика : учебное пособие / А. Н. Герасимов,
Е. И. Громов, Ю. С. Скрипниченко. — Ростов н/Д: Феникс,
2017. — 540, [1] с. — (Высшее образование).**

ОГЛАВЛЕНИЕ

ВВЕДЕНИЕ.....	1
---------------	---

ГЛАВА 1 ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОГО ИССЛЕДОВАНИЯ.....	9
---	----------

1.1. Эконометрика как наука.....	9
1.2. Предмет эконометрики.....	12
1.3. Цели и задачи эконометрики.....	13
1.4. Критерии и принципы эконометрики.....	14
1.5. Основные этапы эконометрического моделирования.....	16
1.6. Общее представление о стохастических и детерминированных процессах.....	18
1.7. Методы прогнозирования: интуитивный, формализованный.....	21
<i>Контрольные вопросы.....</i>	<i>24</i>
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний.....</i>	<i>24</i>
<i>Практикум.....</i>	<i>27</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>52</i>

ГЛАВА 2 ПОДГОТОВКА ЭМПИРИЧЕСКОЙ БАЗЫ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОГО ИССЛЕДОВАНИЯ.....	61
---	-----------

2.1. Формирование эмпирической базы исследования.....	61
2.2. Предварительная обработка статистических данных.....	63
2.3. Интерполирование статистических данных.....	67
2.4. Методы многомерных сравнений.....	69
<i>Контрольные вопросы.....</i>	<i>73</i>
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний.....</i>	<i>74</i>
<i>Практикум.....</i>	<i>78</i>
<i>Задачи для самостоятельного решения.....</i>	<i>97</i>

ГЛАВА 3 СПЕЦИФИКАЦИЯ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ.....	107
---	------------

3.1. Организация процесса построения эконометрических моделей.....	107
3.2. Спецификация эконометрических моделей.....	109
3.3. Методы отбора факторов при построении регрессионных моделей.....	115
3.4. Выбор формы уравнения множественной регрессии.....	117
3.5. Фиктивные переменные.....	119
3.6. Основные эконометрические модели и их типы.....	122
3.7. Применение эконометрических моделей.....	126

<i>Контрольные вопросы</i>	127
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	128
<i>Практикум</i>	131
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	1 34

ГЛАВА 4

ОЦЕНКА ПАРАМЕТРОВ РЕГРЕССИОННЫХ УРАВНЕНИЙ	137
4.1. Метод наименьших квадратов (МНК).....	137
4.2. Предпосылки МНК.....	143
4.3. Мультиколлинеарность.....	152
4.4. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК).....	1 57
<i>Контрольные вопросы</i>	163
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	164
<i>Практикум</i>	167
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	192

ГЛАВА 5

ИДЕНТИФИКАЦИЯ ПАРНЫХ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ	200
5.1. Статистическая корректность эконометрической модели.....	200
5.2. Идентификация парной линейной регрессионной модели.....	202
5.3. Статистическое изучение парной нелинейной регрессионной эконометрической модели.....	210
5.4. Оценка адекватности модели.....	215
5.5. Верификация регрессионных моделей.....	216
<i>Контрольные вопросы</i>	219
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	220
<i>Практикум</i>	223
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	234

ГЛАВА 6

ИДЕНТИФИКАЦИЯ МНОГОФАКТОРНЫХ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ МОДЕЛЕЙ	242
6.1. Идентификация множественной регрессии.....	242
6.2. Частные регрессия и корреляция.....	245
6.3. Оценка статистической значимости уравнения множественной регрессии.....	250
<i>Контрольные вопросы</i>	253
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	254
<i>Практикум</i>	258
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	266

ГЛАВА 7

ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ

ВОСПРОИЗВОДСТВЕННОГО ПРОЦЕССА	276
7.1. Анализ производства и издержек.....	276
7.2. Типы производственных функций.....	278
7.3. Производственная функция Кобба-Дугласа.....	283
7.4. Функции издержек.....	285
7.5. Анализ спроса и предложения.....	286
7.6. Анализ инвестиций и основных фондов.....	290
7.7. Эконометрические модели экономического роста.....	292
<i>Контрольные вопросы</i>	294
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	295
<i>Практикум</i>	298
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	312

ГЛАВА 8

ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ДИНАМИКИ

СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ	315
8.1. Классификация и компонентный анализ рядов динамики.....	315
8.2. Методология регрессионного анализа тенденции временного ряда.....	319
8.3. Методы измерения устойчивости тенденций динамики.....	322
8.4. Моделирование сезонных и циклических колебаний временного ряда.....	324
8.5. Моделирование тенденции ряда динамики при наличии структурных изменений.....	328
8.6. Корреляционный анализ временных рядов данных.....	334
8.7. Прогнозирование тенденции временного ряда.....	336
<i>Контрольные вопросы</i>	340
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	340
<i>Практикум</i>	343
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	367

ГЛАВА 9

ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ СЛОЖНЫХ ДИНАМИЧЕСКИХ СИСТЕМ.....

9.1. Характеристика классов динамических эконометрических моделей.....	377
9.2. Регрессионный анализ связанных динамических рядов.....	378

9.3. Теория коинтеграции временных рядов.....	384
9.4. Интерпретация параметров моделей с распределенным лагом ...	387
9.5. Выбор формы модели с распределенным лагом.....	388
9.6. Авторегрессионные модели.....	397
9.7. Оценка параметров моделей авторегрессии.....	400
9.8. Новые направления в анализе многомерных временных рядов.....	402
<i>Контрольные вопросы</i>	408
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	409
<i>Практикум</i>	412
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	420

ГЛАВА 10

СИСТЕМЫ ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИХ УРАВНЕНИЙ	422
10.1. Необходимость использования систем уравнений.....	422
10.2. Составляющие и формы систем уравнений в эконометрических исследованиях.....	425
10.3. Смещенность и несостоятельность оценок МНК для систем одновременных уравнений.....	430
10.4. Проблема идентификации.....	434
10.5. Методология оценивания параметров систем уравнений.....	439
10.5.1. Косвенный метод наименьших квадратов (КМНК).....	440
10.5.2. Двухшаговый метод наименьших квадратов (ДМНК).....	443
10.5.3. Трехшаговый метод наименьших квадратов (ТМНК).....	447
10.6. Применение систем эконометрических уравнений.....	449
<i>Контрольные вопросы</i>	453
<i>Тестовые задания для самостоятельной проверки знаний</i>	454
<i>Практикум</i>	457
<i>Задачи для самостоятельного решения</i>	489
Контрольное тестирование знаний	492
Глоссарий	530
Приложения	534
Список литературы	540