

Объектом электронного учебника является издание **Яновский Л.П.** Введение в эконометрику : учебное пособие / Л.П. Яновский, А.Г. Буховец ; под ред. Л.П. Яновского. — 2-е изд., доп. — М. : КНОРУС. Рекомендовано УМО по образованию в области экономики и экономической теории

ГЛАВА 1. СУЩНОСТЬ И ИСТОРИЯ ВОЗНИКНОВЕНИЯ ЭКОНОМЕТРИКИ

ГЛАВА 2. ПАРНЫЙ РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ. Основные понятия регрессионного анализа. Регрессия по методу наименьших квадратов (МНК). Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии. Точечный и интервальный прогнозы по уравнению парной регрессии

ГЛАВА 3. МНОЖЕСТВЕННАЯ РЕГРЕССИЯ. МНК-модель. Оценки математического ожидания и ковариаций. Оценка качества. Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции. Проблема мультиколлинеарности факторов. Метод главных компонент. Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными. Тест Чоу для проверки структурных изменений модели. Выбор модели оптимальной сложности. Критерии Акайке и Шварца

ГЛАВА 4. ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНОСТЬ МОДЕЛЕЙ, ЕЕ ОБНАРУЖЕНИЕ И МЕТОДЫ УСТРАНЕНИЯ

ГЛАВА 5. МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ВОПРОСЫ ПРОГНОЗИРОВАНИЯ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ. Принципы разработки. Анализ и моделирование. Коррелограмма и ее применение. Выделение тренда в случае нестационарного временного ряда. Автокорреляция остатков. Гармонический анализ

ГЛАВА 6. СГЛАЖИВАНИЕ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ. Линейные фильтры. Метод простой скользящей средней. Методы взвешенных скользящих средних. Простое экспоненциальное сглаживание. Элементы диалога в модуле «Анализ временных рядов ПП STATISTICA». Прогнозирование

ГЛАВА 7. ОДНОВРЕМЕННЫЕ УРАВНЕНИЯ. МЕТОДЫ ИДЕНТИФИКАЦИИ

ГЛАВА 8. МОДЕЛИРОВАНИЕ СТРУКТУРНЫМИ УРАВНЕНИЯМИ. Моделирование структурными уравнениями и диаграммы путей

ГЛАВА 9. РАЗНОСТНЫЕ УРАВНЕНИЯ И ИХ РЕШЕНИЕ

ГЛАВА 10. СТАЦИОНАРНЫЕ ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ, МОДЕЛИ АВТОРЕГРЕССИИ — СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО. Тесты проверки. Процессы авторегрессии — скользящего среднего. Условия стационарности для АРСС(p, q)-процесса. Автокорреляционные функции (АКФ). Построение АРСС-моделей. Селекция моделей АРСС. Алгоритм выбора модели оптимальной сложности для временного ряда в АРСС(p, q)-моделях. Учет сезонности в модели

ГЛАВА 11. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ С ВЫСОКОЙ ИЗМЕНЧИВОСТЬЮ. Авторегрессионные условно гетероскедастические модели (АРУГ-модели). Обобщенные авторегрессионные условно гетероскедастические модели (ОАРУГ-модели). Модели АРУГ-М. ММП-оценка моделей ОАРУГ и АРУГ-М

ГЛАВА 12. ЛОЖНАЯ РЕГРЕССИЯ, КОИНТЕГРАЦИЯ И МОДЕЛИ КОРРЕКТИРОВКИ ОШИБОК.

Проблема обнаружения. Краткосрочные модели, коинтеграция и механизм корректировки ошибок

Введение в эконометрику : электронный учебник / Л.П. Яновский, А.Г. Буховец. — Электрон. дан. — М. : КНОРУС, 2009. — 1 электрон. опт. диск : зв., цв. [2-й завод — 501—1500 экз.]

Минимальные системные требования: **1)** операционная система Microsoft Windows 2000/XP; **2)** процессор с частотой не ниже 500 MHz; **3)** оперативная память 64 Mb и более; **4)** жесткий диск с объемом свободного места не менее 40 Mb; **5)** видеокарта с 8 Mb памяти или лучше; **6)** SVGA монитор с поддержкой разрешения 1024x768; **7)** CD привод 4x или лучше (рекомендуется 16x); **8)** звуковая карта (любая).

© Яновский Л.П., Буховец А.Г., 2009

© ООО «Издательство КноРус», авторские права, 2009

Адрес: 129110, Москва, Б. Переяславская, 46, стр. 7. Телефон / факс: (495) 680-72-54; 680-91-06; 680-19-04. Интернет-сайт: www.knorus.ru
E-mail: izdat@knorus.ru (издательство), com@knorus.ru (опт. и розн. торговля)

© АНО «ИнфоФонд», эксклюзивная интегрированная платформа, научное консультирование, разработка объектов знаний, 2009

Техническая поддержка: (8422) 410267. E-mail: support@education21v.ru

Завод-изготовитель: ООО УЭЗ, 620137, Свердловская обл., г. Екатеринбург, ул. Студенческая, д. 9. Лицензия ВАФ № 77-15 от 21 сентября 2007 года

Электронный учебник «ВВЕДЕНИЕ В ЭКОНОМЕТРИКУ» предназначен для студентов экономических специальностей всех форм обучения, а также аспирантов, преподавателей высших учебных заведений и специалистов. В его основу положено учебное пособие «Введение в эконометрику», авт. Яновский Л.П., Буховец А.Г.

Даны основы эконометрики и статистического анализа одномерных временных рядов. Большое внимание уделено классической парной и множественной регрессии, классическому и обобщенному методам наименьших квадратов. Подробно рассмотрены проблемы, возникающие при построении многомерной регрессии: мультиколлинеарность, фиктивные переменные, гетероскедастичность модели. Приведены анализ одномерных временных рядов и их компонентного состава, а также способы подбора модели поведения. Описаны адаптивные методы в экономическом прогнозировании, методы одновременных уравнений, модели авторегрессии — скользящего среднего и модели с гетероскедастичностью дисперсии.

После прочтения текста студент может в интерактивном режиме провести самоконтроль с помощью тренировочных тестов. Последние составлены очень подробно, практически в постраничном режиме. Повторять попытки найти верный ответ в режиме тренировочных тестов можно многократно, даются отсылки к соответствующим разделам текста учебника. Поэтому студент, успешно справившийся с тренировочным тестированием и обдумавший, почему одни ответы признаны верными, а другие — нет, может быть уверен в том, что овладел базовыми знаниями по теме.

Далее целесообразно воспользоваться глоссарием (словарем терминов), запомнив точные определения новых категорий, вводимых в тему. Список персоналий позволит получить краткие сведения об уче-

ных, внесших наибольший вклад в разработку соответствующих разделов теории.

Наконец, завершить работу помогут контрольные тесты. В отличие от тренировочных, они не дают студенту информации о том, какой ответ в каком задании является верным, но выставляют итоговую оценку по заданиям в целом. Поэтому преподаватель может повторно тестировать не справившихся с контрольными тестами студентов, без риска, что последние механически заучат, какой номер ответа надо выбирать в каждом задании.

Использование электронного учебника «Введение в эконометрику» принесет реальное облегчение трудностей, возникающих при формировании у будущих специалистов теоретических знаний и практических навыков в области изучаемой проблемы, и позволит студентам лучше понимать эту дисциплину, самостоятельно анализировать данные, делать выводы и, в конечном счете, стать квалифицированными специалистами.