

**МИНИСТЕРСТВО ВЫСШЕГО И СРЕДНЕГО
СПЕЦИАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
РЕСПУБЛИКИ УЗБЕКИСТАН**

**ТАШКЕНТСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ЭКОНОМИЧЕСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ**

АБДУЛЛАЕВ А.М., ДЖАМАЛОВ М.С.

ЭКОНОМЕТРИКА-2

УЧЕБНИК

Ташкент – 2011

Абдуллаев А.М., Джамалов М.С. Эконометрика-2. Учебник для ВУЗов. –Т.: 2011. 612 с.

В учебнике изложены вопросы эконометрического моделирования, учета зависимостей между факторами и мультиколлинеарности при построении эконометрических моделей, а также классические модели линейной и множественной регрессии. Описаны различные аспекты и методы исследования временных рядов, дисперсионного, корреляционного и факторного анализа, рассмотрены методы построения системы эконометрических уравнений, динамических эконометрических моделей, а также методы экспертного оценивания, используемые при содержательной интерпретации результатов эконометрических исследований.

Для студентов экономических специальностей вузов, аспирантов, преподавателей, научных сотрудников и специалистов по прикладной экономике, статистике и финансам.

Рецензенты: д.э.н., проф. Салимов Б.Т.
д.э.н., проф. Шермухамедов А.Т.

Рекомендовано Министерством высшего и среднего специального образования Республики Узбекистан в качестве учебника для студентов высших учебных заведений.

© Абдуллаев А.М. и др. Издательство «Фан ва технология», 2010.

СОДЕРЖАНИЕ

Введение	7
Основные свойства экономической системы, которые учитываются в эконометрических моделях	9
Глава 1. Введение в анализ временных рядов.....	25
1.1. Понятие временного ряда	25
1.2. Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры	34
1.3. Моделирование тенденции временного ряда	40
1.4. Моделирование тенденции временного ряда при наличии структурных изменений	46
1.5. Изучение взаимосвязей по временным рядам	52
1.5.1. Специфика статистической оценки взаимосвязи двух временных рядов	52
1.5.2. Методы исключения тенденции	53
1.5.3. Автокорреляция в остатках. Критерий Дарбина-Уотсона.....	60
1.5.4. Оценивание параметров уравнения регрессии при наличии автокорреляции в остатках	64
1.5.5. Адаптивные модели прогнозирования.....	67
Глава 2. Применение метода наименьших квадратов к обработке экономической информации	72
2.1. Общие замечания	72
2.2. Качественное описание совокупности данных.....	73
2.3. Количественное описание совокупности данных	78
2.4. Метод наименьших квадратов как вычислительный прием.....	84
2.5. Применение метода наименьших квадратов при обработке связанных рядов динамики.....	93
2.6. Обобщенный метод наименьших квадратов	101
Глава 3. Корреляционный анализ.....	107
3.1. Общие замечания	107
3.2. Корреляционные методы измерения тесноты связи	107
3.3. Непараметрические методы оценки тесноты связи	115
3.4. Измерение тесноты связи между рядами динамики.....	120
3.5. Автокорреляция и авторегрессия.....	123