

ОГЛАВЛЕНИЕ

1. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ.....	5
1.1. Основные понятия.....	5
1.2. Основные регрессионные модели.....	8
1.3. Метод наименьших квадратов	8
1.4. Парная линейная регрессия, МНК-оценки параметров.....	10
1.5. Выборочный коэффициент корреляции, проверка его значимости	11
1.6. Значимость уравнения регрессии. Критерий Фишера	14
1.7. Значимость коэффициента регрессии	16
1.8. Коэффициент детерминации.....	17
1.9. Предпосылки МНК. Теорема Гаусса–Маркова.....	18
1.10. Критерий Дарбина–Уотсона	19
1.11. Коэффициент эластичности	20
1.12. Прогнозирование по модели линейной регрессии.....	21
1.13. Параболическая модель регрессии, оценка ее значимости	28
1.14. Степенная модель и оценка ее значимости.....	28
1.15. Множественная регрессия.....	29
1.16. Значимость параметров и функции множественной линейной регрессии.....	32
1.17. Стандартизированное уравнение множественной регрессии	34
1.18. Мультиколлинеарность	35
1.19. Частная корреляция.....	38
1.20. Нелинейные регрессионные модели	39
Контрольные вопросы и задания	40
2. ВВЕДЕНИЕ В АНАЛИЗ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ	48
2.1. Основные понятия.....	48
2.2. Стационарные временные ряды. Основные характеристики	49
2.3. Определение детерминированной составляющей временного ряда	50
2.4. Сглаживание временного ряда.....	52
2.5. Определение сезонной компоненты.....	54

2.6. Прогнозирование по тренду и сезонной составляющей временного ряда	57
Контрольные вопросы и задания	60
3. СИСТЕМЫ ОДНОВРЕМЕННЫХ УРАВНЕНИЙ.....	62
3.1. Основные понятия.....	62
3.2. Идентифицируемость СОУ	64
3.3. Условия идентифицируемости СОУ	65
3.4. Косвенный МНК. Двухшаговый МНК.....	68
Контрольные вопросы и задания	69
4. ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ	71
4.1. Тест	71
4.2. Контрольная работа по теме «Основы регрессионного анализа»	76
4.3. Контрольная работа по теме «Анализ временных рядов»	79
СПИСОК РЕКОМЕНДУЕМОЙ ЛИТЕРАТУРЫ.....	80
ПРИЛОЖЕНИЕ	82