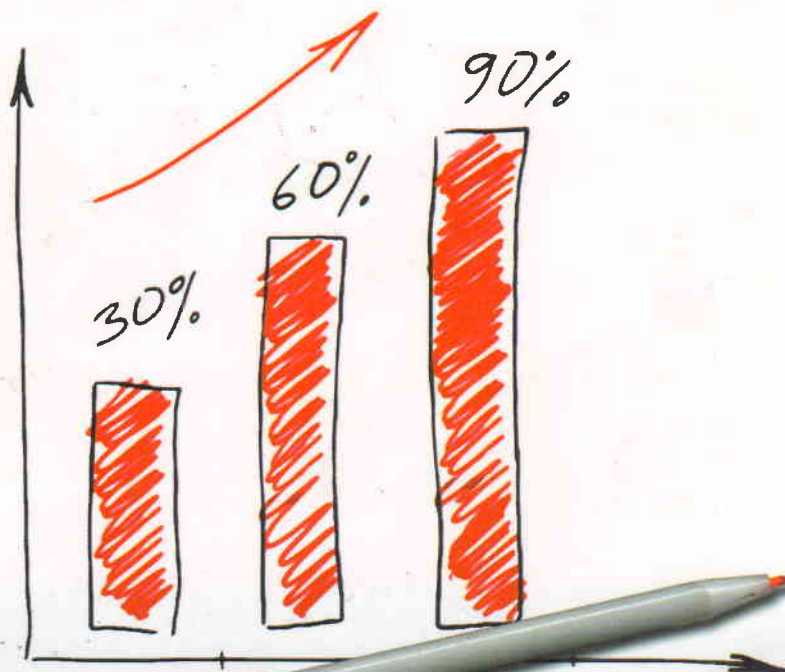


А.В. ГЛАДИЛИН, А.Н. ГЕРАСИМОВ, Е.И. ГРОМОВ

ЭКОНОМЕТРИКА

УЧЕБНОЕ ПОСОБИЕ



КНОРУС

УДК 330(075.8)
ББК 65.01я73
Г52

Рецензенты:

Л.И. Ушвицкий, заслуженный деятель науки Российской Федерации, д-р экон. наук, проф.,
П.В. Акиннин, д-р экон. наук, проф.

Гладилин А.В.

Г52 Эконометрика : учебное пособие / А.В. Гладилин, А.Н. Герасимов, Е.И. Громов. — 2-е изд., стер. — М. : КНОРУС, 2009. — 232 с.

ISBN 978-5-390-00105-9

Рассматриваются основные методы и приемы анализа экономических процессов, порядок спецификации, параметризации и верификации экономических моделей парной и множественной регрессии. Большой материал посвящен анализу временных рядов и системам одновременных уравнений.

Для студентов, аспирантов, преподавателей вузов, а также для специалистов аналитических служб организаций.

Санитарно-эпидемиологическое заключение
№ 77.99.60.953.Д.000035.01.08 от 09.01.2008 г.

Изд. № 1034.

Формат 60×90/16. Гарнитура «Times». Печать офсетная. Бумага газетная.
Усл. печ. л. 14,5. Уч.-изд. л. 7,8. Тираж 2000 (2-й завод 1001—2000) экз. Заказ № 2307.

ЗАО «КноРус», 129110, Москва, ул. Большая Переяславская, 46.

Тел.: (495) 680-7254, 680-0671, 680-1278.

E-mail: office@knorus.ru <http://www.book.ru>

Отпечатано в ОАО «Домодедовская типография».
142000, Московская обл., г. Домоделово, Каширское ш., д. 4/1

ISBN 978-5-390-00105-9

© Гладилин А.В., Герасимов А.Н.,
Громов Е.И., 2009
© ЗАО «КноРус», 2009

Введение

Эконометрика — сравнительно молодая, но быстро развивающаяся научная дисциплина. Постоянно усложняющиеся экономические процессы ведут к необходимости создания и совершенствования методов их изучения и анализа. Современная наука все шире использует математический и статистический аппарат для своих исследований. На практике распространение получили количественный анализ и моделирование.

Сегодня эконометрика получила всемирное признание. Если в период плановой экономики в нашей стране упор делался на балансовых и оптимизационных методах и моделях, то с переходом к рыночной системе эти модели выглядят архаичными, все более возрастает роль эконометрических методов. Только на их основе возможно исследование и теоретическое обобщение эмпирических зависимостей экономических переменных и построение качественного прогноза в бизнесе.

Согласно дословному переводу термин «эконометрика» означает «измерения в экономике». В самом общем виде **эконометрика** — это наука, изучающая количественные и качественные взаимосвязи и взаимозависимости в экономике при помощи математико-статистических методов. Несомненно, что область исследований этой науки значительно шире.

По мнению Л. Клейна, основная задача эконометрики заключается в наполнении эмпирическим содержанием априорных экономических рассуждений. Следовательно, предметом эконометрики являются социально-экономические явления и процессы. Изучение экономических явлений в эконометрике осуществляется посредством специальных методов и моделей, позволяющих на базе экономической теории, социально-экономической статистики и математико-статистического инструментария придавать количественные выражения качественным зависимостям.

Каждая из перечисленных дисциплин играет определенную роль в эконометрическом исследовании. На основе экономической теории разрабатываются концепции развития изучаемых процессов с учетом их