

ВЫСШЕЕ ОБРАЗОВАНИЕ

ЭКОНОМЕТРИКА

УЧЕБНОЕ ПОСОБИЕ

А. И. НОВИКОВ

www.infra-m.ru



УДК 330.115(075.8)

ББК 65вбяр73

Н73

Рецензенты:

Б.И. Клячин, канд. физ.-мат. наук, доцент, заведующий кафедрой математики Московской высшей школы бизнеса;

М.Ю. Крылков, канд. техн. наук, доцент кафедры математики Московского горного института

Новиков А.И.

Н73

Эконометрика: Учеб. пособие. — 2-е изд., испр. и доп. — ИНФРА-М, 2010. — 144 с. — (Высшее образование).

ISBN 978-5-16-002974-0

Содержит систематическое изложение основ эконометрики, подготовлено в соответствии с требованиями государственного стандарта. Рассмотрены линейная модель парной и множественной регрессии, проверка гипотез, гетероскедастичность и автокорреляция ошибок. Отдельные главы посвящены динамическим моделям и системам одновременных уравнений.

Для студентов экономических вузов, ориентированных на решение практических задач моделирования и прогнозирования в экономике.

ББК 65в

ISBN 978-5-16-002974-0

© А.И. Новиков, 2003,

Оригинал-макет изготовлен в Издательском Доме «ИНФРА-М»

ЛР № 070824 от 21.01.93 г.

Сдано в набор 10.08.2006. Подписано в печать 29.01.2007.

Формат 60×88/16. Бумага офсетная. Гарнитура Newton.

Усл. печ. л. 8,82. Уч.-изд. л. 8,97.

Доп. тираж 3000 экз. Заказ № 2100.

Издательский Дом «ИНФРА-М»

127282, Москва, ул. Полярная, д. 31в

Тел.: (495) 380-05-40, 380-05-43. Факс: (495) 363-92-12.

E-mail: books@infra-m.ru

<http://www.infra-m.ru>

Отдел «Книга — почтой»:

(495) 363-42-60 (доб. 246, 247)

Отпечатано в ОАО «Домодедовская типография»
г. Домодедово, Каширское ш., д. 4, к. 1.

Предисловие

В современных программах подготовки экономистов курс эконометрики наряду с микро- и макроэкономикой занял одно из ключевых мест.

Экономисты используют количественные данные для наблюдения за развитием экономики, для ее анализа и прогнозов. Набор статистических методов, используемых для этих целей, и составляет в совокупности эконометрику.

При изложении курса эконометрики используется минимальный математический аппарат, основанный на понятиях и свойствах ковариации и дисперсии. В начале курса приведены необходимые элементы математической статистики.

Все излагаемые методы и подходы в эконометрике иллюстрируются примерами и упражнениями с использованием пакета анализа данных Excel.

Эта книга предназначена студентам, впервые приступающим к изучению эконометрики.