

УДК 330.115(075.8)

ББК 65.в6я73

М48

Электронные версии книг  
на сайте [www.prospekt.org](http://www.prospekt.org)

**Автор:**

**Р. М. Мельников**, профессор кафедры государственного регулирования экономики МИГСУ, доктор экономических наук.

**Рецензенты:**

**В. В. Дик**, доктор экономических наук, профессор;

**А. П. Рязанцев**, доктор экономических наук, профессор.

**Мельников Р. М.**

М48 Эконометрика : учебное пособие. — Москва : Проспект, 2014. — 288 с.

ISBN 978-5-392-13134-1

В учебном пособии представлены основные теоретические положения, используемые при проведении эмпирического анализа и прогнозирования тенденций развития экономических процессов, базирующегося на применении эконометрических методов, а также конкретные примеры, раскрывающие различные возможности и направления использования эконометрического инструментария в прикладных исследованиях. Рассматриваются методы и подходы, позволяющие изучать влияние внешних факторов на динамику развития национальной экономики России, формирование обменного курса рубля, тенденции движения фондовых индексов. Значительное внимание уделяется особенностям применения эконометрических методов для оценки финансовых рисков, в частности в рамках методик RiskMetrics, CorporateMetrics и CreditMetrics.

УДК 330.115(075.8)

ББК 65.в6я73

*Учебное издание*

**Мельников Роман Михайлович**

**ЭКОНОМЕТРИКА**

**Учебное пособие**

Оригинал-макет подготовлен компанией ООО «Оригинал-макет»

[www.o-maket.ru](http://www.o-maket.ru); тел.: (495) 726-18-84

Санитарно-эпидемиологическое заключение

№ 77.99.60.953.Д.004173.04.09 от 17.04.2009 г.

Подписано в печать 20.01.2014. Формат 60×90 1/16.

Печать офсетная. Печ. л. 18,0. Тираж 500 экз. Заказ №

ООО «Проспект»

111020, г. Москва, ул. Боровая, д. 7, стр. 4.

ISBN 978-5-392-13134-1

© Мельников Р. М., 2014

© ООО «Проспект», 2014

## ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение .....	3
<b>Глава 1.</b> Введение в регрессионный анализ .....	4
<b>Глава 2.</b> Проверка гипотез и построение доверительных интервалов .....	19
<b>Глава 3.</b> Множественный регрессионный анализ .....	33
<b>Глава 4.</b> Нелинейные эконометрические модели .....	51
<b>Глава 5.</b> Гетероскедастичность и автокорреляция остатков .....	63
<b>Глава 6.</b> Одномерные модели временных рядов .....	82
<b>Глава 7.</b> Модели авторегрессионной условной гетероскедастичности .....	109
<b>Глава 8.</b> Многомерные модели временных рядов .....	117
<b>Глава 9.</b> Системы одновременных уравнений .....	154
<b>Глава 10.</b> Модели с ограниченными зависимыми переменными .....	175
<b>Глава 11.</b> Особенности регрессионного анализа панельных данных .....	193
<b>Глава 12.</b> Эконометрическая оценка финансовых рисков с использованием методики RiskMetrics .....	211
<b>Глава 13.</b> Эконометрическая оценка рыночных рисков нефинансовых компаний с использованием методики CorporateMetrics .....	231
<b>Глава 14.</b> Эконометрическая оценка кредитных рисков с использованием методики CreditMetrics .....	250
Примерные темы учебных исследовательских проектов и краткие методические указания по их реализации .....	274
Литература .....	277
Глоссарий .....	278