

УДК 330.115(075.8)
ББК 65.в6я73
М18

Электронные версии книг
на сайте www.prospekt.org

Автор:

Малова А. С. — кандидат экономических наук, старший преподаватель кафедры экономической кибернетики СПбГУ, приглашенный преподаватель СПбГЭУ (программы второго высшего образования, президентская программа, Master of International Business Administration). Преподает эконометрику, статистический анализ бизнес-информации, статистические методы в менеджменте.

Рецензент:

Подкорытова О. А. — кандидат физико-математических наук, доцент кафедры экономической кибернетики СПбГУ.

Малова А. С.

М18 Основы эконометрики в среде GRETЛ : учебное пособие. — Москва : Проспект, 2016. — 112 с.

ISBN 978-5-392-20334-5

Данное пособие представляет собой вспомогательный методический материал для работы в эконометрической среде GRETЛ. Оно предназначено студентам бакалавриата по направлениям «Экономика», «Бизнес-информатика», «Управление персоналом», «Менеджмент» для использования на практических и семинарских занятиях по курсу «Эконометрика (пространственные данные)», а также может использоваться любыми заинтересованными лицами в качестве краткого руководства по использованию GRETЛ.

Пособие включает в себя обзор основных тем базового курса «Эконометрика», подробный разбор возможностей и функций эконометрического пакета GRETЛ, а также примеры практической реализации тех или иных методов.

В данном издании для иллюстрации возможностей эконометрического пакета использовались примеры из учебника Jeffrey M. Wooldridge «Introductory Econometrics: A Modern Approach, 2nd edition». Все файлы с данными находятся в открытом доступе и могут быть свободно использованы. Пособие организовано таким образом, что читатель имеет возможность самостоятельно проделать все действия, необходимые для решения стоящей перед ним эконометрической задачи.

УДК 330.115(075.8)
ББК 65.в6я73

Учебное издание

Малова Александра Сергеевна

ОСНОВЫ ЭКОНОМЕТРИКИ В СРЕДЕ GRETЛ

Учебное пособие

Оригинал-макет подготовлен компанией ООО «Оригинал-макет»
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 20.01.2016. Формат 60×90^{1/16}.

Печать цифровая. Печ. л. 7,0. Тираж 1000 (1-й завод 50) экз. Заказ №

ООО «Проспект»

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

ISBN 978-5-392-20334-5

© Малова А. С., 2016
© ООО «Проспект», 2016

СОДЕРЖАНИЕ

Введение.....	3
1. Линейная регрессионная модель	5
2. Оценка линейной регрессионной модели	6
3. Тест Фишера (Fisher test).....	9
4. Тест Стьюдента (t-test)	12
5. Проверка гипотезы о совместной незначимости коэффициентов	20
6. Проверка правильности спецификации модели (RESET test).....	25
7. Проверка качества регрессионной модели (коэффициент детерминации), информационные критерии	29
8. Интерпретация коэффициентов регрессии и прогнозирование	33
9. Оценка регрессии в логарифмах и интерпретация	37
10. Проверка линейных ограничений на коэффициенты регрессии	40
11. Фиктивные переменные (dummy variables).....	44
12. Тест Чоу (test Chow)	56
13. Мультиколлинеарность (Multicollinearity).....	64
14. Гетероскедастичность (Heteroscedasticity).....	69
15. Автокорреляция (Autocorrelation)	79
16. Logit- и probit-модели	88
17. Системы одновременных уравнений	103
Список литературы	111
ПО и файлы с данными	111