

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО
ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
«САМАРСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АЭРОКОСМИЧЕСКИЙ
УНИВЕРСИТЕТ имени академика С.П. КОРОЛЁВА
(НАЦИОНАЛЬНЫЙ ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ)»

О.А. КУЗНЕЦОВА, М.С. ТАТАРНИКОВА

ЭКОНОМЕТРИЧЕСКОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ

*Утверждено Редакционно-издательским советом университета
в качестве учебного пособия*

Самара
Издательство СГАУ
2012

УДК СГАУ: 33
ББК 65в6
К89

Рецензент д-р экон. наук, проф. М. И. Гераскин

Кузнецова О.А.
К89 **Эконометрическое моделирование:** учеб. пособие / *О.А. Кузнецова, М.С. Татарникова*. – Самара: Изд-во Самар. гос. аэрокосм. ун-та, 2012. – 44 с.

ISBN 978-5-7883-0892-0

Рассмотрены процесс создания модели, её оценка и анализ. Исследуются особенности моделирования парной и множественной регрессии, систем уравнений, особенности моделирования временных рядов и учёт факторов тренда и сезонности, а также модели формирования портфелей инвестиций.

Предназначено для студентов специальности 080116.65 «Математические методы в экономике», обучающихся по очной форме обучения. Выполнено на кафедре ММЭ.

УДК СГАУ: 33
ББК 65в6

ISBN 978-5-7883-0892-0

© Самарский государственный
аэрокосмический университет, 2012

ОГЛАВЛЕНИЕ

Введение.....	4
1. Основные этапы моделирования.....	5
2. Парная регрессия	10
3. Множественная регрессия	17
4. Система эконометрических уравнений	25
5. Временные ряды в эконометрических исследованиях.....	27
6. Оптимизация инвестиционного портфеля по модели Марковица	33
7. Оптимизация инвестиционного портфеля по модели Шарпа.....	36
Библиографический список.....	40