

ПРЕДИСЛОВИЕ

Пособие "Введение в эконометрику. Часть 2. Эконометрика и регрессионный анализ" продолжает серию пособий, задуманных автором в помощь тем, кто решил познакомиться с данной дисциплиной. В первой части рассматривались вопросы, связанные с использованием методов Математической статистики.

В соответствии с определением данным "Эконометрике" в процессе ее создания "Обществом эконометристов" (www.econometricsociety.org) она является разумным и равноправным сочетанием трех элементов. Во-первых, экономической статистики, которая обеспечивает механизмы формирования различного рода измерений, лежащих в основе проводимых исследований. Во-вторых, общей экономической теории, которая обеспечивает эконометрику необходимой теоретической базой для формирования начальных предположений. В-третьих, математики, которая предоставляет инструментарий для оценки адекватности моделей, формируемых на основе общей экономической теории, имеющегося опыта практической работы или просто здравого смысла, с использованием накопленных данных полученных в соответствии с рекомендациями экономической статистики.

Исторически сложилось так, что заметную роль в математическом обеспечении этой дисциплины играет регрессионный анализ. Предлагаемое студентами и преподавателям учебное пособие охватывает в основном те разделы Эконометрики, в которых он активно используется и которые принято относить к классическим разделам дисциплины. Изложение ориентировано на студентов и специалистов, которые планируют связать свою деятельность с решением аналитических задач в экономике и прослушали курсы "Математический анализ", "Теория вероятностей и математическая статистика", а также "Микро-" и "Макроэкономика", и "Экономическая статистика".

Центральным понятием пособия, как и всего курса, является понятие "модель". Его определение и специфика использования соответствуют определению, которое используется в SADT (Методология структурного анализа и проектирования). Практика показывает, что разумное сочетание этих двух дисциплин на практике дает хорошие результаты.

Отличительной чертой пособия является его практический характер, в частности, ориентация на возможность решения задач с использованием компьютеров. Это определяет выбор разделов регрессионного анализа, используемых в нем.