

СЪДЪРЖАНИЕ

Предговор.....	7
Първа глава. ВЪВЕДЕНИЕ В ИКОНОМЕТРИЯТА	9
1.1. Иконометрията като научна област.....	9
1.2. Възникване и историческо развитие на иконометрията.....	12
1.3. Същност, цел и задачи на иконометричното изследване	15
1.4. Иконометричен модел: същност, свойства, елементи. Паралел на иконометричния с икономическия модел.....	17
Втора глава. ИНФОРМАЦИОННА БАЗА НА ИКОНОМЕТРИЧНИЯ АНАЛИЗ	22
2.1. Основни типове статистически данни, използвани за целите на иконометричния анализ	22
2.2. Статистически данни в статика и динамика	23
2.3. Източници на данни за иконометричен анализ	30
Трета глава. ИКОНОМЕТРИЧНО МОДЕЛИРАНЕ НА ЗАВИСИМОСТИ	32
3.1. Същност на иконометричното моделиране на зависимости	32
Четвърта глава. КОЛИЧЕСТВЕНИ ИЗМЕРИТЕЛИ НА ЗАВИСИМОСТТА	43
4.1. Същност и видове количествени измерители на зависимостта	43
Пета глава. ПРОВЕРКИ НА СТАТИСТИЧЕСКИ ХИПОТЕЗИ ПРИ ЕДИНИЧНАТА ЛИНЕЙНА РЕГРЕСИЯ	50
5.1. Основни положения.....	50
5.2. Проверка за адекватност на иконометричния модел	50
5.3. Стохастична точност на параметрите на модела.....	52
5.4. Проверка за статистическата значимост на параметрите на модела.....	54
Шеста глава. ДИАГНОСТИКА НА ОСТАТЪЧНИЯ КОМПОНЕНТ ПРИ ЕДИНИЧНАТА ЛИНЕЙНА РЕГРЕСИЯ	62
6.1. Същност на диагностиката на остатъчния компонент	62
6.2. Проверка на хипотеза за нормално разпределение на остатъците....	62
6.3. Проверка на хипотеза за хомоскедастичност на остатъците.....	64
6.4. Проверка на хипотеза за серийна независимост на остатъците	66

Седма глава. МНОЖЕСТВЕНА РЕГРЕСИЯ	74
7.1. Множествена регресия: същност и видове. Множествен линеен регресионен модел (МЛРМ)	74
7.2. Оценка на параметрите на множествен линеен регресионен модел. Приложение на метода на най-малките квадрати (МНК)	75
7.3. Анализ на качеството на оценения регресионен модел	77
7.4. Количествени измерители на корелационните зависимости, базирани на регресионния модел	77
Осма глава. ПОСТРОЯВАНЕ НА МНОЖЕСТВЕН РЕГРЕСИОНЕН МОДЕЛ	87
8.1. Ограничения и проблеми, свързани с избора на фактори в множествения регресионен модел. Колинеарност и мултиколинеарност – същност, проблеми, методи за установяване и преодоляване	87
8.2. Основни статистически критерии за избор на фактори в множествения регресионен модел.....	91
8.3. Статистически подходи и процедури за избор на факторни променливи в множествения регресионен модел	93
8.4. Множествен регресионен модел с категорични факторни променливи.....	103
Девета глава. ИКОНОМЕТРИЧНО МОДЕЛИРАНЕ НА ДИНАМИКА: ВЪВЕДЕНИЕ	108
9.1. Същност на икономическите динамични редове	108
9.2. Видове динамични редове	109
9.3. Компоненти на динамичните редове	110
9.4. Критерии за установяване на тенденцията на развитие в един динамичен ред.....	113
Десета глава. ИКОНОМЕТРИЧНО МОДЕЛИРАНЕ НА ТЕНДЕНЦИЯТА НА РАЗВИТИЕ	121
10.1. Моделиране на тенденцията на развитие с права линия	121
10.2. Експоненциален трендови модел	125
10.3. Изследване на качеството на използвания модел за описване на тенденцията на развитие – коефициент на детерминация	129
10.4. Прогнозиране чрез използване на трендовите модели – екстраполационни прогнози.....	131

Единадесета глава. СЕЗОННОСТ В ДИНАМИЧНИТЕ ИКОНОМИЧЕСКИ РЕДОВЕ	133
11.1. Същност на сезонните колебания.....	133
11.2. Връзки между компонентите на динамичните редове – адитивна и мултипликативна връзка	135
11.3. Метод на простите средни	136
11.4. Метод на отношенията на фактическите към изгладените стойности.....	140
Дванадесета глава. ПРОБЛЕМИ НА ИКОНОМЕТРИЧНИЯ АНАЛИЗ ПО ДАННИ ОТ ВРЕМЕВИ РЕДОВЕ	147
12.1. Основни проблеми на иконометричния анализ по данни от времеви редове.....	147
12.2. Осигуряване на ценова съпоставимост на времеви редове.....	147
12.3. Отстраняване на трендови компонент	150
12.4. Други основни въпроси на приложението на регресионния и корелационния анализ по данни от времеви редове	159
Препоръчителна литература	160
Приложения.....	161