

САНКТ-ПЕТЕРБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Учебно-методический центр
по обучению и переподготовке аудиторов СПбГУ

В. М. Буре, Е. А. Евсеев

ЭКОНОМЕТРИКА:
ПРАКТИКУМ НА ПК

Учебно-методическое пособие



ИЗДАТЕЛЬСТВО С.-ПЕТЕРБУРГСКОГО УНИВЕРСИТЕТА
2003

УДК 330.43(075.8)
ББК 65в6я73
Б90

Рецензент кандидат физ.-мат. наук, доцент *В. А. Уланов* (С.-Петербург.
торг.-экон. ин-т)

*Печатается по решению Методического совета
Учебно-методического центра
С.-Петербургского государственного университета*

Буре В. М., Евсеев Е. А.

Б90. Эконометрика: практикум на ПК: Учебно-методическое пособие. — СПб.: Изд-во С.-Петерб. ун-та, 2003. — 60 с.
ISBN 5-288-03265-3

В пособии приведены лабораторные работы по основным начальным разделам эконометрики: парному линейному и нелинейному регрессионному анализу, множественной линейной регрессии, анализу временных рядов. Выполнение работ предусматривает использование пакета Microsoft Office, в частности MS Excel. В каждой работе сформулирована решаемая задача, содержится подробное и полное изложение алгоритма вычислений с указанием в случае необходимости основных формул, а также подробное описание средств Excel для проведения эконометрических расчетов. Последовательное выполнение предлагаемых работ формирует у читателя отчетливое понимание основных рассмотренных алгоритмов и методов эконометрического анализа, а также навык практического проведения эконометрических расчетов с использованием стандартного офисного программного обеспечения.

Пособие предназначено для студентов при изучении курса эконометрики, курсов, использующих количественные методы и методологию статистического анализа, а также для повышения квалификации практикующих экономистов и аудиторов.

ББК 65в6я73

© В. М. Буре,
Е. А. Евсеев, 2003
© Издательство
С.-Петербургского
университета, 2003

ISBN 5-288-03265-3

ПРЕДИСЛОВИЕ

В последнее время заметно вырос интерес к эконометрике — науке, изучающей количественные взаимосвязи экономических явлений и процессов. Практическое применение эконометрических методов предполагает использование компьютеров для решения конкретных задач, проведения числовых расчетов. Этот аспект не нашел должного отражения в многочисленных публикациях, посвященных данной теме.

В предлагаемом пособии приведены лабораторные работы по основным начальным разделам эконометрики: парному линейному и нелинейному регрессионному анализу, множественной линейной регрессии, анализу временных рядов. Выполнение работ предусматривает использование пакета Microsoft Office, в частности MS Excel, возможностей которого достаточно для решения подобных задач.

В каждой работе сформулирована решаемая задача и алгоритм вычислений, содержится изложение последовательности расчетов с указанием в случае необходимости основных формул, а также описание средств Excel, применяемых для выполнения эконометрических расчетов. По существу лабораторная работа представляет собой подробное описание некоторой вычислительной процедуры, используемой при проведении эконометрического анализа. Первая работа посвящена знакомству с основами обработки статистических данных с помощью Excel.

Список рекомендуемой литературы в конце пособия представлен книгами, содержащими полное теоретическое изложение основ эконометрики. Перед текстом лабораторных работ приведены основные формулы эконометрики, используемые в работах. Приложение включает в себя необходимые статистические таблицы.

В основу пособия положены курсы лекций и практических занятий по эконометрике в соответствии с программой факультета прикладной математики — процессов управления Санкт-Петербургского государственного университета и Международного банковского института.

Последовательное выполнение предлагаемых работ формирует у читателя отчетливое понимание основных рассмотренных алгоритмов и методов эконометрического анализа, а также навык практического проведения эконометрических расчетов с использованием стандартного офисного программного обеспечения.