

Содержание

Глава 1. Предисловие	6
Глава 2. Модель парной регрессии	8
Глава 3. Модель множественной регрессии	36
Глава 4. Различные аспекты множественной регрессии	105
Глава 5. Некоторые обобщения множественной регрессии	157
Глава 6. Гетероскедастичность и корреляция по времени	171
Глава 7. Прогнозирование в регрессионных моделях	225
Глава 8. Инструментальные переменные	230
Глава 9. Системы регрессионных уравнений	236
Глава 10. Метод максимального правдоподобия в моделях регрессии	246
Глава 11. Временные ряды	269
Глава 12. Дискретные зависимые переменные и цензурированные выборки	302
Глава 13. Панельные данные	337
Глава 14. Предварительное тестирование: введение	354
Глава 15. Эконометрика финансовых рынков	359