

УМУМЛАШГАН МОМЕНТЛАР УСУЛИ БАҲОСИ ВА УНИНГ ҚЎЛЛАНИЛИШИ

Гузал Сайдиллаевна Абдужалилова

Мирзо Улуғбек номидаги Ўзбекистон миллий университети, Эконометрика ва
иқтисодий моделлаштириш кафедраси таянч докторанти

rasulova2406@gmail.com

АННОТАЦИЯ

Номаълум параметрларни баҳолашда бир қанча усуллар мавжуд бўлиб, улар ичида ҳақиқатга максимал ўхшашлик усули кенг қўлланиладиган усуллардан бири ҳисобланади. Ушбу усул ёрдамида олинган баҳолар асимптотик нормаллик, асимптотик эффективлик каби бир қанча яхши хоссаларга эга бўлади. Аммо тасодифий миқдор математик қутилмаси мавжуд бўлмаса ёки ҳақиқатга максимал ўхшашлик тенгламаси аниқ ечилмаса бу усуллар ишламайди ҳамда бошқа баҳолаш усуллардан фойдаланишга тўғри келади. Иқтисодиётда бир қанча жараёнлар тақсимотлари маълум ўрганилган тақсимот бўлган ҳолда ҳам баҳолаш турли сабабларга кўра қийинчилик туғдириши мумкин. Ушбу мақолада умумлашган моментлар усули, бу усул ёрдамида олинган баҳоларнинг асимптотик хоссалари ўрганилади.

Калит сўзлар: баҳолаш, вақтли қаторлар, умумлашган моментлар усули, характеристик функциялар, эффективлик.

ABSTRACT

There are various methods for estimating an unknown parameter. The most common of them are the maximum likelihood method and the method of moments. These methods allow us to obtain consistent, effective estimates and they are asymptotically normal under general conditions. However, in the case when the random variables does not have a mathematical expectation, or the likelihood equation is not solved explicitly, then these methods do not work and in these cases we have to look for other methods. There are many processes in economics where the maximum likelihood approach is difficult to implement, both in the independently identically distributed case and in the dependent case. In this paper, we study a generalized method of moments for evaluating models of a linear time series. The obtained estimates are compared with traditional estimation methods, such as the maximum likelihood method. Investigated the properties of the estimation: asymptotic unbiased and consistency.

Keywords: estimation, time series, generalized method of moments, characteristic function, efficiently.