


«Утверждено»

на заседании кафедры ММ

протокол № 5

«11» декабря 2017г.

Зав. каф.  Мустафина С.А.

**Вопросы к экзамену по дисциплине: «Эконометрика» (продвинутый уровень)  
для экономического факультета**

Составитель: к.х.н., доцент Иремадзе Э.О.

1. Гипотеза о существовании связи между экономическими показателями. Объясняемые и объясняющие переменные, эконометрическая модель.
2. Линейные уравнения (классическая модель).
3. Метод наименьших квадратов и его свойства.
4. Декомпозиция суммы квадратов отклонений от объясняемой переменной.
5. Коэффициенты множественной детерминации.
6. Оценивание линейного уравнения регрессии, параметры которого удовлетворяют линейным ограничениям, заданным в форме равенств.
7. Линейное уравнение регрессии с независимыми и нормально распределенными ошибками.
8. Формулировка и проверка линейных гипотез о параметрах.
9. Учет неоднородности множества наблюдений.
10. Проверка существенности структурных изменений в уравнении регрессии.
11. Обобщенный метод наименьших квадратов и его свойства.
12. Гетероскедастичность, ее экономические причины и методы выявления.
13. Оценивание регрессии в условиях гетероскедастичности ошибок.
14. Показатели мультиколлинеарности и методы борьбы с нею.
15. Метод главных компонент.
16. Экономические причины автокоррелированности случайных ошибок.
17. Модель авторегрессии ошибок первого порядка.
18. Диагностирование автокорреляции.
19. Оценивание регрессии в условиях автокорреляции ошибок.
20. Выбор «наилучшей» модели линейной регрессии при заданном наборе потенциальных факторов.
21. Последствия выбора неправильной формы уравнения регрессии.
22. Дискретные зависимые переменные: номинальные, ранжированные, количественные. Probit и Logit модели.
23. Модели, представленные системами одновременных линейных уравнений.
24. Структурная и приведенная формы моделей.
25. Системы одновременных уравнений. Проблемы оценивания.
26. Неприменимость МНК в случае коррелированности регрессоров и случайной ошибки.
27. Инструментальные переменные. Тест Хаусмана.
28. Косвенный МНК.
29. Двухшаговый МНК и метод инструментальных переменных.
30. Трехшаговый МНК.
31. Преимущества использования панельных данных.
32. Понятие о модели со специфическим индивидуальным эффектом.
33. Спецификация модели. Детерминированный и случайный индивидуальный эффект.
34. Сравнительный анализ оценок моделей панельной регрессии.
35. Эконометрические модели интегрированного типа.