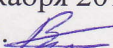


«Утверждено»
на заседании кафедры ММ
протокол № 5
«11» декабря 2017 г.
Зав. каф.  Мустафина С.А.

**Перечень вопросов к экзамену
по дисциплине «Эконометрика»**

Составитель: доцент Ирмадзе Э.О.

- 1 Определение эконометрики. Предмет и методы эконометрики.
- 2 Классификация моделей и типы данных.
- 3 Этапы построения эконометрической модели.
- 4 Модель парной регрессии.
- 5 Случайный член, причины его существования.
- 6 Условия нормальной линейной регрессии (Гаусса-Маркова)
- 7 Метод наименьших квадратов.
- 8 Свойства коэффициентов регрессии.
- 9 Нелинейная регрессия. Методы линеаризации.
- 10 Функциональная спецификация модели парной регрессии.
- 11 Интерпретация линейного уравнения регрессии.
- 12 Определение тесноты связи между факторами: линейный коэффициент корреляции, коэффициент детерминации.
- 13 Оценка тесноты связи в нелинейной регрессионной модели.
- 14 Оценка существенности параметров и статистическая проверка гипотез. t-критерий Стьюдента.
- 15 Взаимосвязь t-статистики и F-статистики для парной регрессии.
- 16 Коэффициент эластичности. Его смысл и определение.
- 17 Оценка статистической значимости уравнения в целом. F-критерий Фишера.
- 18 Модель множественной регрессии.
- 19 Ограничения модели множественной регрессии.
- 20 Идентификация параметров множественной регрессии МНК.
- 21 Интерпретация множественного уравнения регрессии.
- 22 Показатели тесноты связи в множественном регрессионном анализе - парные и частные коэффициенты корреляции.
- 23 Стандартизированное уравнение множественной регрессии.
- 24 Коэффициент множественной корреляции, скорректированный коэффициент множественной корреляции, множественный коэффициент детерминации.
- 25 Оценка статистической значимости множественных коэффициентов регрессии, t-критерий Стьюдента.
- 26 Модели с переменной структурой (фиктивные переменные).
- 27 Оценка статистической значимости множественного уравнения регрессии, F-критерий Фишера.
- 28 Спецификация модели множественной регрессии. Свойства множественных коэффициентов регрессии.
- 29 Решение проблемы выбора модели (с ограничением и без ограничения).
- 30 Методы отбора факторов: априорный и апостериорный подходы.
- 31 Гетероскедастичность и автокорреляция случайного члена.
- 32 Автокорреляция 1-го порядка и критерий Дарбина-Уотсона.
- 33 Тест серий (критерий Бреуша-Годфри)
- 34 Обобщенная регрессионная модель
- 35 Тесты на гетероскедастичность: Голдфелда-Квандта, тест Уайта.
- 36 Системы регрессионных (одновременных) уравнений.
- 37 Структурная и приведенная формы модели.
- 38 Эндогенные и экзогенные переменные. Проблема идентифицируемости систем уравнений.
- 39 Оценивание параметров в системах одновременных уравнений: косвенный и двухшаговый МНК.
- 40 Основные модели временных рядов.
- 41 Проверка точности и адекватности моделей временных рядов.
- 42 Модели распределенных лагов.