

**Вопросы к зачету по дисциплине «Эконометрика»
для заочного отделения
2012-2013 уч. г.**

1. Определение эконометрики и ступени выделения в особую науку.
2. Парная линейная регрессия. Нелинейная регрессия.
3. Число степеней свободы факторной и остаточной сумм квадратов.
4. Критерий Фишера.
5. Критерий Стьюдента.
6. Средняя ошибка аппроксимации.
7. Метод наименьших квадратов.
8. Надежность уравнения регрессии и его параметров.
9. Критерий Фишера и его назначение.
10. Коллинеарность и мультиколлинеарность факторов.
11. Коэффициент эластичности в линейной и степенной функции
12. Множественная регрессия.
13. Индекс множественной корреляции.
14. Значимость уравнения регрессии и отдельных коэффициентов.
15. Фиктивные переменные.
16. Средние частные коэффициенты эластичности.
17. Стандартизованные переменные.
18. Уравнение линейной регрессии в стандартизованном масштабе.
19. Коэффициент корреляции.
20. Гомоскедастичность. Гипотеза о гомоскедастичности ряда остатков.
21. Виды систем эконометрических уравнений.
22. Структурная форма эконометрических уравнений.
23. Приведенная форма эконометрических уравнений.
24. Идентификация модели. Необходимое и достаточное условие идентификации моделей.
25. Косвенный МНК.
26. Двухшаговый МНК.
27. Модель регрессии по временным рядам данных.
28. Методы исключения тенденции, их преимущества и недостатки.
29. Метод отклонения от тренда.
30. Метод последовательных разностей.
31. Фактор времени в моделях регрессии.
32. Автокорреляция в остатках.
33. Критерий Дарбина – Уотсона.
34. Алгоритм применения критерия Дарбина - Уотсона для тестирования модели регрессии на автокорреляцию в остатках.
35. Основные этапы обобщенного МНК.
36. Параметры модели с распределенным лагом.
37. Интерпретация параметров модели авторегрессии.
38. Метод инструментальных переменных для оценки параметров модели авторегрессии.

Ст.преп.Павлова Л.А.