ПИТАННЯ ДО ІСПИТУ
Економетрика

1. Предмет, методи і завдання економетрики
2. Оцінка параметрів лінійної економетричної моделі методом найменших квадратів (1 МНК): їх властивості і характеристика
3. Коваріаційна матриця оцінок параметрів моделі
4. Коефіцієнт детермінації та його властивості.
5. Тест Глейзера для виявлення ознаки гетероскедастичності в моделі
6. Матриця парних коефіцієнтів кореляції, та частні коефіцієнти кореляції і їх властивості.
7. Особливості економетричних моделей.
8. Перевірка загальної якості моделі та рівності двох коефіцієнтів детермінації.
9. Використання критерію Дарбіна-Уотсона для виявлення ознаки автокореляції в моделі.
10. Коефіцієнт еластичності. Суть цього коефіцієнта.
11. Статистичний аналіз моделі. Перевірка на статистичну значущість параметрів теоретичної лінійної парної регресії і коефіцієнта кореляції.
12. Тест Гельфельда-Квандта для виявлення ознаки гетероскедастичності в моделі.
13. Авторегресійний процес першого порядку.
14. Статистичний аналіз моделі. Побудова довірчих інтервалів із заданою надійністю.
15. Графічний метод виявлення ознаки автокореляції в моделі.
16. Умови Гаусса-Маркова для множинної регресії.
17. Проста економетрична модель.
18. Поняття моделі та етапи її побудови.
19. Специфікація моделі.
20. Передумови застосування методу найменших квадратів.
21. Оцінювання прогнозних можливостей моделі.
22. Побудова економетричної моделі на основі покрокової регресії.
23. Побудова моделі багатофакторної регресії.
24. Поняття мультиколінеарності та основні наслідки мультиколінеарності.
25. Ознаки мультиколінеарності.
26. Алгоритм Фаррара-Глобера. Методи звільнення від мультиколінеарності.
27. Нелінійні однофакторні економетричні моделі, їхні властивості.
28. Методи оцінки параметрів нелінійних моделей.
29. Виробнича функція Кобба-Дугласа, її властивості й оцінка параметрів.
30. Поняття гетероскедастичності.
31. Наслідки гетероскедастичності.
32. Методи визначення гетероскедастичності.
33. Поняття автокореляції та наслідки автокореляції.
34. Методи визначення автокореляції.
35. Узагальнений метод найменших квадратів (метод Ейткена).
36. Оцінювання параметрів моделі з автокорельованими залишками.
37. Оцінювання моделей з автокорельованими залишками.
38. Системи одночасних структурних рівнянь.
39. Структурна форма економетричної моделі.
40. Зведена форма економетричної моделі.
41. Рекурсивні системи.
42. Непрямий метод найменших квадратів.