* **Вопросы к экзамену**
1. Эконометрика как наука.
2. Предмет эконометрики.
3. Задачи эконометрики.
4. Эконометрическая модель и ее виды, используемые в эконометрике.
5. Типы данных и виды переменных.
6. Этапы эконометрического моделирования.
7. Сущность и задачи корреляционно-регрессионного анализа.
8. Метод наименьших квадратов для оценки параметров линейной модели.
9. Линейный коэффициент корреляции. Коэффициент детерминации.
10. Оценка статистической значимости параметров линейной регрессии.
11. Оценка статистической значимости параметров линейной корреляции.
12. Прогнозирование по линейному уравнению регрессии.
13. Средняя ошибка аппроксимации.
14. Классификация нелинейной регрессии.
15. Коэффициенты эластичности для нелинейных регрессий.
16. Корреляция для нелинейной регрессии.
17. Предпосылки МНК.
18. Отбор факторов при построении множественной регрессии.
19. Оценка параметров уравнения множественной регрессии.
20. Частные коэффициенты корреляции.
21. Парные коэффициенты корреляции.
22. Оценка статистической значимости уравнения регрессии в целом и его параметров.
23. Проверка статистической значимости коэффициентов корреляции.
24. Множественный коэффициент корреляции и детерминации.
25. Значимость множественного коэффициентов корреляции и детерминации.
26. Уравнение регрессии с переменной структурой.
27. Тест Чоу.
28. Суть гетероскедастичности.
29. Последствия гетероскедастичности.
30. Обнаружение гетероскедастичности.
31. Методы смягчения проблемы гетероскедастичности.
32. Суть мультиколлинеарности.
33. Последствия мультиколлинеарности.
34. Определение мультиколлинеарности.
35. Методы устранения мультиколлинеарности.
36. Суть и причины автокорреляции.
37. Последствия автокорреляции.
38. Обнаружение автокорреляции.
39. Методы устранения автокорреляции.
40. Основные элементы временного ряда.
41. Моделирование тенденции временного ряда.
42. Моделирование сезонных и циклических колебаний.
43. Стационарные стохастические процессы.
44. Общая характеристика моделей авторегрессии.
45. Оценка параметров моделей авторегрессии.
46. Модели скользящего среднего.
47. Общее понятие о системах уравнений, используемых в эконометрике.
48. Структурная и приведенная формы модели.
49. Проблема идентификации.
50. Оценивание параметров структурной модели.
51. Косвенный метод наименьших квадратов.
52. Двухшаговый метод наименьших квадратов.
53. Трехшаговый метод наименьших квадратов.