ВОПРОСЫ ДЛЯ САМОПОДГОТОВКИ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ «ЭКОНОМЕТРИКА»

1. Этапы построения эконометрической модели.
2. Краткая характеристика цели каждого этапа.
3. Знания из каких научных дисциплин необходимы на каждом из этапов эконометрического моделирования?
4. В чем состоит спецификация модели множественной регрессии?
5. Почему в уравнении регрессии присутствует случайная переменная?
6. Как определить силу и направленность взаимодействия факторов?
7. Что означает значимость коэффициента корреляции?
8. Как проверить на значимость коэффициент корреляции?
9. В чем суть МНК для нахождения оценок параметров регрессии?
10. Почему с помощью МНК находятся оценки параметров, а не их точные значения?
11. Какая оценка параметра называется точечной?
12. В чем суть интервальной оценки параметров?
13. Как найти интервальные оценки коэффициентов регрессии?
14. Как используются стандартные ошибки регрессии и стандартные ошибки коэффициентов регрессии при анализе оценок параметров регрессии?
15. В чем экономический смысл параметров модели регресии?
16. Как можно оценить общее качество уравнения регрессии?
17. Какова суть коэффициента детерминации, нормированного коэффициента детерминации? В каких пределах они изменяются?
18. Какова связь между коэффициентом детерминации, коэффициентом корреляции и множественным коэффициентом корреляции для множественной регрессии?
19. Для какой цели в парной регрессии используется критерий Фишера?
20. Как получить остатки для модели парной регрессии?
21. Какому условию должны удовлетворять остатки, чтобы для проверки статистических гипотез можно было использовать критерий Стьюдента?
22. Какое распределение называется нормальным? Каковы его параметры?
23. Какими способами можно проверить нормальность распределения остатков?
24. Как используется критерий согласия Пирсона для проверки гипотезы о нормальном законе распределения остатков?
25. Для чего и как проверяется значимость коэффициентов регрессии?
26. Какими свойствами должны обладать оценки параметров регрессии?
27. Основные предпосылки применения МНК для построения регрессионной модели.
28. Каковы последствия невыполнимости предпосылок применения МНК?
29. Как сформулировать теорему Гаусса-Маркова?
30. Как проверить центрированность остатков?
31. В чем суть гетероскедастичности (гомоскедастичности) остатков?
32. Каковы причины и последствия гетероскедастичности остатков?
33. Как определить гомоскедастичность остатков?
34. В чем суть автокорреляции остатков? Каковы ее последствия?
35. Как проверить гипотезу об отсутствии автокорреляции остатков с помощью критерия Дарбина-Уотсона?
36. Как проверить гипотезу об отсутствии автокорреляции остатков визуально?
37. Что характеризуют средние коэффициенты эластичности?
38. Для чего используются частные коэффициенты корреляции? Как они рассчитываются?
39. Каковы последствия мультиколлинеарности остатков?
40. Что представляет собой прогнозирование?
41. Как получить точечный прогноз зависимого фактора?
42. Как получить интервальный прогноз зависимого фактора?
43. Каково определение модели временного ряда?
44. Какие известны основные компоненты временного ряда?
45. Каковы основные цели исследования временных рядов?
46. Как использовать автокорреляционную функцию при анализе структуры временного ряда?
47. Как рассчитывается коэффициент автокорреляции пятого порядка?
48. Как строится коррелограмма?
49. Каков общий вид мультипликативной и аддитивной моделей временного ряда?
50. С какой целью проводится анализ структуры сезонных колебаний временного ряда?
51. Какие тесты используются для проверки гипотезы о структурной стабильности временного ряда?
52. В каком случае нарушается структурная стабильность временного ряда?
53. Что понимается под аналитическим выравниванием временного ряда?
54. Каковы известны наиболее распространенные модели, используемые для аналитического выравнивания временного ряда?
55. Что понимается под линеаризующими преобразованиями? Как они используются в МНК?
56. Как оценивается качество построенной модели?
57. Как осуществляется точечный прогноз по модели временного ряда?
58. Что такое временной ряд?
59. Назовите основные компоненты временного ряда.
60. Каковы цели исследования временных рядов?
61. Для чего используется автокорреляционная функция?
62. Как рассчитывается коэффициент автокорреляции третьего порядка?
63. Что такое коррелограмма?
64. Как осуществляется выбор вида мультипликативной и аддитивной моделей временного ряда?
65. Как выделить сезонную составляющую временного ряда?
66. Для чего необходимо сглаживать временной ряд?
67. Назовите методы сглаживания временного ряда.
68. Какие функции используются для аналитического выравнивания временного ряда?
69. Как осуществить прогноз по аддитивной или мультипликативной модели временного ряда?
70. Что понимают под ложной корреляцией?
71. Какова суть метода отклонений от тренда?
72. В каком случае используется ОМНК?
73. Каковы основные этапы ОМНК?
74. Как осуществляется прогнозирование?
75. Каковы основные причины использования систем одновременных уравнений?
76. В чем состоит основное различие между структурной и приведенной формами?
77. Почему не применим МНК для оценки структурных коэффициентов модели?
78. Для оценки каких систем возможно применение МНК?
79. Что понимают под экзогенными и эндогенными переменными?
80. Что представляет собой сверхидентифицируемая система?
81. Как сформулировать необходимое условие идентификации?
82. Как сформулировать достаточное условие идентификации?
83. В чем состоит суть двухшагового метода наименьших квадратов?
84. Этапы косвенного метода наименьших квадратов.
85. Существует ли единый критерий для оценки общего качества всей системы одновременных уравнений в целом?
86. Какой вид имеет модель «спрос - предложение»?
87. Какой метод оценок параметров целесообразен для точно идентифицируемого уравнения?
88. Какова система рекурсивных уравнений?