

ПИТАННЯ ДО ЗАЛІКУ
з дисципліни «Економетрика»

1. Визначення економетрії як науки, її природа. Приклади використання економетричних моделей для розв'язування економічних задач.
2. Роль економетричних досліджень в економіці.
3. Основні типи економетричних моделей. Змінні та рівняння в економетричних моделях.
4. Етапи економетричного моделювання економічних процесів та явищ.
5. Загальний вигляд лінійної економетричної моделі та етапи її побудови.
6. Специфікація економетричної моделі.
7. Метод найменших квадратів.
8. Властивості статистичних оцінок параметрів, їх характеристика.
9. Поняття адекватності і точності економетричної моделі .
- 10.Перевірка значущості оцінок параметрів економетричної моделі, статистичні критерії.
- 11.Перевірка статистичної значущості економетричної моделі в цілому, статистичні критерії.
- 12.Інтервальний прогноз залежної змінної на основі економетричної моделі. Стандартні помилки та надійність прогнозу.
- 13.Проста лінійна регресія. Структура моделі та основні припущення при її побудові.
- 14.Коефіцієнт детермінації.
- 15.Властивості параметрів регресії.
- 16.Гіпотеза про значимість коефіцієнта регресії.
- 17.Гіпотеза про лінійні обмеження на коефіцієнти моделі.
- 18.Перевірка моделі на адекватність.
- 19.Перевірка моделі на стійкість.
- 20.Прогнозування за допомогою простої лінійної регресії.
- 21.Моделі, які зводяться до моделі множинної лінійної регресії.

22. Множинна лінійна регресія. Структура моделі та основні припущення при її побудові. Оцінка моделі.
23. Моделі, які зводяться до моделі множинної лінійної регресії.
24. Виділення сезонних коливань.
25. Економетрична лінійна модель на основі нормалізованих даних.
26. Регресійні залежності довільного типу.
27. Модель Коба-Дугласа та її оцінка.
28. Інтерпретація коефіцієнтів регресії. Порівняння факторів за ступенем їх впливу. Економічний зміст коефіцієнтів регресії.
29. Поняття мультиколінеарності, її природа.
30. Вплив мультиколінеарності на оцінки параметрів моделі.
31. Непрямий метод найменших квадратів оцінювання параметрів строго ідентифікованих рівнянь системи.
32. Міри точності прогнозів.
33. Методи експоненціального згладжування: звичайне, подвійне, потрійне.
34. Побудова лінійної та лінійно-логарифмічної виробничої функції. Економетричний аналіз виробничих функцій, інтерпретація результатів.
35. Перспективи економетрики.