**Вопросы к экзамену по курсу «ЭКОНОМЕТРИКА»**

1. Эконометрическая модель.
2. Измерения в экономике. Шкалы измерений.
3. Случайные события и случайные переменные. Распределение случайных величин.
4. Статистические характеристики случайных величин и их свойства.
5. Основные функции распределения.
6. Оценки статистических характеристик и их желательные свойства.
7. Проверка статистических гипотез.
8. Критерий и критическая область.
9. Мощность статистического критерия. Уровень значимости.
10. Модель линейной регрессии.
11. Оценивание параметров регрессии. Метод наименьших квадратов.
12. Система нормальных уравнений МНК и ее решение.
13. Свойства оценок параметров, полученных методом наименьших квадратов. Условия Гаусса – Маркова.
14. Коэффициент детерминации и его свойства.
15. Предположение о нормальном распределении случайной ошибки в рамках классической линейной регрессии и его следствия.
16. Доверительные интервалы оценок параметров и проверка гипотез об их значимости.
17. Прогнозирование по регрессионной модели и его точность. Доверительные и интервалы прогноза.
18. Ковариационная матрица оценок коэффициентов регрессии.
19. Проверка значимости коэффициентов и адекватности регрессии для множественной линейной регрессионной модели.
20. Коэффициент множественной детерминации. Скорректированный коэффициент детерминации.
21. Проблемы спецификации регрессионной модели. Пошаговая регрессия.
22. Замещающие переменные. Фиктивные переменные.
23. Мультиколлинеарность. Влияние мультиколлинеарности на оценки параметров уравнения регрессии.
24. Методы борьбы с мультиколлинеарностью.
25. Парная нелинейная регрессия.
26. Линеаризация регрессионных моделей путем логарифмических преобразований.
27. Модели с постоянной эластичностью. Производственная функция Кобба - Дугласа.
28. Модель с постоянными темпами роста (полулогарифмическая модель).
29. Полиномиальная регрессия.
30. Гетероскедастичность. Последствия гетероскедастичности для оценок параметров регрессии методом наименьших квадратов и проверки статистических гипотез.
31. Признаки гетероскедастичности и ее диагностирование.
32. Оценивание коэффициентов множественной линейной регрессии в условиях гетероскедастичности.
33. Обобщенный метод наименьших квадратов.
34. Автокорреляция. Причины автокорреляции.
35. Влияние автокорреляции на свойства оценок МНК.
36. Тест серий. Статистика Дарбина – Уотсона.
37. Способы противодействия автокореляции.
38. Стохастические объясняющие переменные. Последствия ошибок измерения.
39. Инструментальные переменные.
40. Лаговые переменные и экономические зависимости между разновременными значениями переменных.
41. Модели с распределенными лагами.
42. Авторегрессионные модели, как эквивалентное представление моделей с распределенными лагами.
43. Методы Кохрейна-Оркатта и Хилдрета-Лу.
44. Ожидания экономических агентов и лаговые переменные в моделях
45. Модели наивных и адаптивных ожиданий.
46. Понятие об одновременных уравнениях. Структурная и приведенная форма модели.
47. Проблема идентификации. Неидентифицируемость и сверхидентифицированность.
48. Оценивание системы одновременных уравнений. Косвенный и двухшаговый МНК.
49. Системы эконометрических уравнений с лаговыми переменными.
50. Модели Кейнса и Клейна.

**Литература**

**Доугерти К.** Введение в эконометрику. – М.: ИНФРА-М, 2010.

**Эконометрика**: учебник для бакалавров / под ред. И.И. Елисеевой. – М.: Проспект, 2013.

**Практикум по эконометрике**: учебное пособие / И.И. Елисеева, С.В. Курышева, Н.М. Гордеенко и др.; под ред. И.И. Елисеевой. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Финансы и статистика, 2007. – 344 с.

**Новиков А.И**. Эконометрика. – М.: Дашков и К