

## **Перечень вопросов к экзамену по дисциплине «Эконометрика»**

1. Понятие эконометрики. История возникновения. Сфера применения эконометрики.
2. Методы, используемые в эконометрических исследованиях.
3. Этапы проведения эконометрического исследования.
4. Оценка параметров линейной регрессии.
5. Оценка значимости параметров парного уравнения регрессии.
6. Линейная регрессия и корреляция, ее применение в эконометрических исследованиях.
7. Предпосылки метода наименьших квадратов и их учет в регрессионном анализе.
8. Оценка существенности параметров линейной регрессии и корреляции: t-критерий Стьюдента, его связь с F- критерием.
9. Интервалы прогноза по линейному уравнению регрессии.
10. Нелинейная регрессия и корреляция.
11. Средняя ошибка аппроксимации и ее роль в эконометрическом исследовании.
12. Спецификация моделей множественной регрессии.
13. Отбор факторов при построении модели регрессии.
14. Мультиколлинеарность факторов и учет ее при построении моделей регрессии.
15. Преодоление мультиколлинеарности при построении модели регрессии.
16. Оценка параметров уравнения множественной регрессии.
17. Уравнение множественной регрессии в натуральном и стандартизированном виде.
18. Характеристика эластичности по модели множественной регрессии.
19. Взаимосвязь стандартизированных коэффициентов регрессии и коэффициентов эластичности.
20. Показатели множественной и частной корреляции. Их роль при построении эконометрических моделей.
21. Оценка надежности результатов множественной регрессии.
22. Дисперсионный анализ результатов множественной регрессии.
23. Частный F-критерий Фишера, t- критерий Стьюдента. Их роль в построении регрессионных моделей.
24. Оценка качества регрессионных моделей. Стандартная ошибка линии регрессии.
25. Взаимосвязь частного F-критерия, t- критерия Стьюдента и частного коэффициента корреляции.
26. Варианты построения регрессионной модели. Их краткая характеристика.
27. Интерпретация параметров линейной и нелинейной регрессии.

28. Матрица парных и частных коэффициентов корреляции при построении регрессионных моделей.
29. Исследование остатков уравнения множественной регрессии.
30. Гетероскедастичность и ее учет при построении модели множественной регрессии.
31. Автокорреляция остатков и ее роль при построении регрессионной модели.
32. Выбор наилучшего варианта модели регрессии.