

Магистратура «Мировая торговля и международные экономические организации», «Международное страхование и управление рисками»,
«Международный учёт, анализа и аудит»
Программа курса «Эконометрика II»
декабрь 2016

Web: www.slideshare.net/artamonoff

1 Линейная модель регрессии

Интерпретация коэффициентов, **бинарные переменные**. Статистические свойства OLS-оценок: доверительные интервалы, проверка (простых) гипотез. Проверка гипотез с помощью P-значений. Коэффициент R^2 как показатель «качества подгонки» модели регрессии и его интерпретация. Проверка значимости регрессии «в целом», проверка сложных гипотез о коэффициентах модели регрессии. Понятие гетероскедастичности ошибок модели регрессии и ее последствия. Графический анализ. Тесты White, Breusch-Pagan. Скорректированные по Уайту робастные стандартные ошибки коэффициентов (НС-стандартные ошибки).

2 Модели регрессии с бинарной зависимой переменной

Линейная вероятностная модель LPM, ее недостатки. probit- и logit-модели регрессии. Интерпретация коэффициентов и предельные значения. Проверка простых и сложных гипотез, LR-статистика, проверка значимости регрессии «в целом». Коэффициент R^2 МакФаддена. Информационные критерии, сравнение нескольких регрессий. Прогнозирование в модели LPM, probit, logit.

Вопросы, уточняющие условия задач, не принимаются! Правильное понимание условий задачи входит в экзамен

Правила проведения экзамена по курсу «Эконометрика 2»

1. Продолжительность экзамена: 1 час.
2. Задачи могут включать распечатку Eviews/gretl.
3. Бумага для решения варианта выдается преподавателем.
4. **Вопросы, уточняющие условия задач, не принимаются. Правильное понимание условий задачи входит в экзамен!**
5. Экзаменационная работа должна быть подписана. **Неподписанные работы не проверяются!**
6. Мобильный телефон (смартфон, коммуникатор, iPhone) должен быть выключен.
7. При себе нужно иметь пишущие принадлежности, калькулятор и зачетную книжку. Сумки, верхняя одежда и личные вещи должны быть сложены в угол аудитории.
8. Разрешается пользоваться калькулятором, пользоваться выданными таблицами критических значений распределений.
9. Категорически запрещается:
 - **выходить и заходить в аудиторию в течение всего экзамена;**
 - Откреплять выданные листы бумаги. **Открепленные листы не проверяются!**
 - пользоваться дополнительными материалами;
 - класть мобильный телефон (смартфон, коммуникатор, iPhone) на стол;
 - общаться по мобильному телефону (смартфону, коммуникатору, iPhone);
 - пользоваться мобильным телефоном (смартфоном, коммуникатором, iPhone), в том числе как калькулятором;
 - класть на стол, пользоваться iPod Touch, iPad, планшетными компьютерами, в том числе как калькулятором;

- пользоваться смарт-часам, Apple iWatch, в том числе как калькулятором;
- класть на стол, пользоваться ноутбуком (нетбуком), в том числе как калькулятором
- общаться с другими студентами;
- передавать другим студентам любые предметы, в том числе калькулятор, ручки, карандаши, бумагу, замазку;
- смотреть в чужие работы;
- использовать дополнительную бумагу, кроме выданной преподавателем;

За нарушение правил проведения экзамена выставляется оценка «неудовлетворительно»!