

# ЗМІСТ

<b>ВСТУП.....</b>	<b>7</b>
I. Навчально-тематичний план .....	9
II. Навчально-методичне забезпечення.....	13
<b>ТЕМА 1. ПРЕДМЕТ, МЕТОДИ І ЗАВДАННЯ ДИСЦИПЛІНИ.....</b>	<b>13</b>
1.1. Предмет економетрики.....	14
1.2. Історія виникнення та становлення економетрики .....	17
1.3. Поняття моделі. Класифікація моделей.....	19
1.4. Статистична база економетричних моделей .....	22
1.5. Приклади економетричних моделей .....	26
Питання для самоконтролю .....	28
Практичні завдання .....	29
Тести .....	30
<b>ТЕМА 2. МЕТОДИ ПОБУДОВИ ЗАГАЛЬНОЇ ЛІНІЙНОЇ МОДЕЛІ</b>	<b>32</b>
Частина 2.1. Проста лінійна вибіркова регресія.....	32
2.1.1. Специфікація моделі.....	32
2.1.2. Лінійна регресія: зміст та оцінка параметрів.....	36
2.1.3. Основні припущення, що лежать в основі методу найменших квадратів .....	42
2.1.4. Оцінка значущості параметрів лінійної регресії та кореляції .....	44
2.1.5. Інтервальний прогноз на основі лінійного рівняння регресії.....	48
2.1.6. Нелінійна регресія .....	50
Питання для самоконтролю .....	52
Практичні завдання .....	53
Тести .....	54
Частина 2.2. Множинна регресія .....	60
2.2.1. Відбір факторів для побудови множинної регресії та вибір форми її рівняння	61
2.2.2. Оцінка параметрів рівняння множинної регресії.....	64
2.2.3. Множинна кореляція .....	67
2.2.4. Оцінка надійності результатів регресії та кореляції.....	71
2.2.5. Побудова інтервалів довіри для параметрів регресії та прогнозних значень у	73
Питання для самоконтролю .....	74
Практичні завдання .....	75
Тести .....	75
<b>ТЕМА 3. МУЛЬТИКОЛІНЕАРНІСТЬ ТА ЇЇ ВПЛИВ НА ОЦІНКИ ПАРАМЕТРІВ МОДЕЛІ .....</b>	<b>81</b>
3.1. Визначення мультиколінеарності та її природа .....	81
3.2. Теоретичні та практичні наслідки мультиколінеарності в загальному випадку	82
3.3. Тестування мультиколінеарності та засоби її вилучення.....	84
Питання для самоконтролю .....	88
Практичні завдання .....	88
Тести .....	89
<b>ТЕМА 4. УЗАГАЛЬНЕНИЙ МЕТОД НАЙМЕНШИХ КВАДРАТІВ (УМНК) .....</b>	<b>92</b>
4.1. Визначення гетероскедастичності та її природа .....	92
4.2. Тестування наявності гетероскедастичності .....	94
4.3. Використання УМНК для оцінки параметрів у разі гетероскедастичності	98
Питання для самоконтролю .....	100
Практичні завдання .....	100
Тести .....	101
<b>ТЕМА 5. ЕКОНОМЕТРИЧНІ МОДЕЛІ ДИНАМІКИ .....</b>	<b>104</b>
5.1. Основні елементи часового ряду.....	104
5.2. Автокореляція рівнів часового ряду і виявлення його структури.....	106
5.3. Моделювання тенденції часового ряду.....	110
5.4. Моделювання сезонних і циклічних коливань.....	111
5.5. Стаціонарні і нестаціонарні часові ряди.....	115
Питання для самоконтролю .....	123

Практичні завдання .....	124
Тести .....	126
<b>ТЕМА 6. ЕМПІРИЧНІ МЕТОДИ КІЛЬКІСНОГО АНАЛІЗУ НА ОСНОВІ СТАТИСТИЧНИХ РІВНЯНЬ.....</b>	<b>131</b>
6.1. Специфіка статистичної оцінки взаємозв'язку двох часових рядів	131
6.2. Коінтеграція та хибна (уявна) регресія. Тест Гренджера.....	132
6.3. Методи виключення тенденції.....	135
6.4. Бінарні змінні. Порівняння двох регресій .....	137
Питання для самоконтролю .....	140
Практичні завдання .....	140
Тести .....	142
<b>ТЕМА 7. ПОБУДОВА ЕКОНОМЕТРИЧНОЇ МОДЕЛІ З АВТОКОРЕЛЬОВАНИМИ ЗАЛИШКАМИ .....</b>	<b>145</b>
7.1. Автокореляція в залишках. Критерій Дарбіна-Уотсона.....	145
7.2. Оцінювання параметрів рівняння регресії при автокореляції в залишках	150
Питання для самоконтролю .....	153
Практичні завдання .....	154
Тести .....	155
<b>ТЕМА 8. МЕТОДИ ІНСТРУМЕНТАЛЬНИХ ЗМІННИХ .....</b>	<b>156</b>
8.1. Сутність методу інструментальних змінних .....	156
8.2. Підходи до визначення параметрів моделі методами інструментальних змінних	157
Питання для самоконтролю .....	160
Практичні завдання .....	160
Тести .....	162
<b>ТЕМА 9. МОДЕЛІ РОЗПОДІЛЕНОГО ЛАГУ.....</b>	<b>164</b>
9.1. Поняття лагу і лагових змінних. Взаємна кореляційна функція .....	164
9.2. Вивчення структури лагу і вибір виду моделі.....	168
9.3. Метод Койка.....	173
9.4. Моделі часткових пристосувань та адаптивних очікувань .....	176
9.5. Методи оцінювання параметрів лагової моделі .....	178
9.6. Метод Ейткена .....	182
Питання для самоконтролю .....	183
Практичні завдання .....	183
Тести .....	184
<b>ТЕМА 10. ЕКОНОМЕТРИЧНІ МОДЕЛІ НА ОСНОВІ СИСТЕМИ СТРУКТУРНИХ РІВНЯНЬ.....</b>	<b>186</b>
10.1. Поняття про систему одночасних рівнянь.....	186
10.2. Структурна і приведена форма моделі.....	188
10.3. Ідентифікованість та неідентифікованість моделі .....	189
10.4. Оцінка параметрів системи одночасних рівнянь .....	190
10.5. Приклади застосування СОР .....	190
Питання для самоконтролю .....	196
Практичні завдання .....	196
Тести .....	197
III. Індивідуальні завдання.....	199
3.1. Парна регресія і кореляція .....	199
3.2. Множинна регресія і кореляція .....	206
3.3. Часові ряди .....	216
3.4. Системи одночасних рівнянь.....	218
<b>РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА .....</b>	<b>221</b>
<b>ІМЕННИЙ ПОКАЖЧИК.....</b>	<b>222</b>
<b>ДОДАТКИ.....</b>	<b>226</b>

---

