

## **Завдання для самостійної роботи з курсу «Економетрика»**

1. Виконайте завдання самостійної роботи Вашого варіанту (варіанти знаходяться на с.2-5 даного документу). Номер варіанту відповідає Вашому номеру у списку журналів груп «Міжнародна економіка» та «Економічна теорія».
2. Якщо у завданні 1 вказано назву методу або моделі, то слід реферативно описати суть методу, розглянути приклад його використання, навести необхідну інформацію по його застосуванню. Якщо у завданні 1 вказано автора-економетриста, то слід написати звіт про роботу та основні досягнення відомого економетриста, зазначити його коротку біографію, основні праці, результати, їхнє застосування в сучасній економіці, здобуті нагороди, навести найбільш значимі результати і моделі.
3. Задачі завдання 2 розв'язуються з НМК «Економетрика». Теоретична задача має бути розв'язана без використання статистичних пакетів, практична має бути розв'язана у середовищі Mathematica.
4. Викладач залишає за собою право задати питання по суті викладеного матеріалу, розумінню методів, моделей, розв'язків.
5. Результати роботи слід оформити у вигляді **скріпленого надрукованого** документу обсягом 10-15 сторінок, що має містити:
  - a. титульну сторінку (обов'язково слід вказати номер варіанту та прізвище виконавця);
  - b. виконані завдання роботи (кожне завдання має починатися з нової сторінки);
  - c. список використаної літератури (на окремій сторінці).
6. Роботу слід вкласти до прозорого файлу разом з **дискетою**<sup>1</sup>, що містить електронну версію роботи (разом з відповідним файлом в середовищі Mathematica), та здати викладачу **до 10.15 14 грудня 2006 року**. Роботи, здані після цієї дати, отримують оцінку 1.

---

<sup>1</sup> Замість дискети рекомендується надіслати електронну версію завдання (реферат та файли виконаних завдань) у архіві (zip або rar) на адресу **SOEI@univ.kiev.ua**, вказавши у полі тема ключову фразу "ECO\_06\_Self". Реєстрація робіт проходить у автоматичному режимі, тому невиконання вимог призведе до втрати роботи.

## Варіанти завдання 1

1. DSGE-моделі
2. RESET – тест
3. VAR-моделі.
4. Аль-Ош (Al-Osh M.)
5. Аналітичні види тренду
6. Бокс (Box)
7. Бреуш (Breush)
8. Вальд (Wald)
9. Василій Леонт'єв
10. Вест (West M.)
11. Вінер (Wiener)
12. Вінтерс (Winters)
13. Глаубер
14. Глейзер (Glejzer)
15. Голдфельд (Goldfeld)
16. Грейнджер (Granger C.W.J.)
17. Грін В. (Greene W.)
18. Дарбін (Durbin)
19. Деніель Мак-Фадден
20. Джеймс Тобін
21. Джеймс Хекман
22. Дженкінс (Jenkins)
23. Джон Нэш
24. Дігл П. (Diggle P.)
25. Діккі Д. (Dickey D.)
26. Експертні методи прогнозування
27. Енгл (Engle R.F.)
28. Застосування функції Хубера
29. Інструментальні змінні
30. Кальман
31. Квондт (Quandt)
32. Коінтеграція та її застосування.
33. Кокс Д. (Cox D.)
34. Кочрейн (Cochrane)
35. Критерій Вальда
36. Лоуренс Клейн
37. Лу (Lu)
38. Лукас (Lucas R.E.)
39. Метод максимальної правдоподібності для оцінки регресій
40. Метод максимальної правдоподібності для перевірки гіпотез
41. Методи Census X11 та Census X12
42. Методи експоненціального згладжування
43. Методи оцінки погодженості думок між експертами

44. Міри точності прогнозів
45. Моделі Вінтерса
46. Моделі з панельними даними
47. Моделі множинного вибору
48. Моделі множинного вибору
49. Модель логіт (logit)
50. Модель пробіт (probit)
51. Модель Тобіт
52. Моделі з лаговими змінними.
53. Нелінійний метод найменших квадратів
54. Оркат (Orcutt)
55. Оцінка систем одночасних регресійних рівнянь. Ідентифікація моделей.
56. Оцінка систем регресійних рівнянь.
57. Оцінки вагів для зваженого методу найменших квадратів у формі Нев'є-Веста.
58. Оцінювання виробничо-інституціональних функцій
59. Паган (Pagan)
60. Проблема мультиколінеарності
61. Процедура покрокового відбору змінних
62. Процеси авторегресії зі змінною дисперсією.
63. Рагнар Фріш
64. Рамсей (Ramsey)
65. Роберт Солоу
66. Рональд Коуз
67. Специфікація моделей
68. Статистична обробка експертних оцінок
69. Структурні макроекономічні моделі
70. Структурні макроекономічні моделі
71. Структурні розриви. Бінарні змінні.
72. Структурні розриви. Нелінійність у змінних.
73. Структурні розриви. Тестування на структурні розриви.
74. Стьюдент
75. Тест Бреуша-Пагана (Breush-Pagan)
76. Тест Кокса.
77. Тест Хаусмана
78. Тести на стабільність моделі.
79. Тести Чоу
80. Тестування на автокореляцію.
81. Тестування на наявність коінтеграції.
82. Тестування нелінійних обмежень
83. Триетапний метод найменших квадратів
84. Трюгве Хаавельмо
85. Уайт (White)
86. Узагальнений метод моментів для оцінки регресій
87. Уотсон (Watson M.W.)
88. Фарр

89. Фільтр Кальмана  
 90. Фішер  
 91. Флетчер М. (Fletcher M.)  
 92. Хілдрет (Hildreth C.)  
 93. Холт (Holt)  
 94. Чоу (Chow G.C.)  
 95. Шмідт П. (Schmidt P.)  
 96. Ян Тінберген

## Варіанти завдання 2

Варіант	Задача 1	Задача 2
1.	1.1	2.21
2.	1.2	2.25
3.	1.3	2.22
4.	1.4	2.20 (1-5)
5.	1.5	2.24
6.	1.6	2.28
7.	1.7	2.25
8.	1.8	2.20 (6-9)
9.	1.9	2.21
10.	1.10	2.26
11.	1.11	2.24
12.	1.12	2.23
13.	1.13	2.19
14.	1.14	2.27
15.	2.1 (1-4)	2.28
16.	2.1 (5-8)	2.26
17.	2.2	2.27
18.	2.3	2.22
19.	2.4	1.20
20.	2.5	1.19
21.	2.6	4.9
22.	2.7 (1-4)	4.10
23.	2.7 (5-8)	4.11
24.	2.8	4.12
25.	2.9	4.13
26.	2.10	4.14
27.	2.11	4.15
28.	2.12	4.16

Варіант	Задача 1	Задача 2
29.	2.13	4.17
30.	2.14	3.9
31.	2.15	3.8
32.	3.1	2.26
33.	3.2	2.28
34.	3.3	2.27
35.	4.1	3.7
36.	4.2	3.6
37.	4.3	3.5
38.	4.4	3.4
39.	4.5	3.9
40.	4.6	3.10
41.	4.7	3.5
42.	5.9	3.4
43.	5.8	2.27
44.	5.7	2.26
45.	5.6	2.25
46.	5.5	2.24
47.	5.4	2.23
48.	5.3	2.22
49.	5.2	2.21
50.	5.1	2.20 (6-9)
51.	5.17	2.20 (1-5)
52.	5.16	2.19
53.	5.15	1.20
54.	5.14	1.19
55.	5.13	1.18
56.	5.12	1.17

<b>Варіант</b>	<b>Задача 1</b>	<b>Задача 2</b>
57.	5.11	1.16
58.	5.10	1.15
59.	4.1	3.6
60.	4.2	3.7
61.	4.3	3.8
62.	4.4	3.9
63.	4.5	3.10
64.	4.6	3.11
65.	3.1	2.22
66.	3.2	2.21
67.	3.3	2.20
68.	1.7	4.17
69.	1.8	4.16
70.	1.9	4.15
71.	2.10	4.14
72.	2.11	4.15
73.	2.12	4.16
74.	2.13	4.17
75.	2.14	3.9
76.	2.15	3.8
77.	3.1	2.26

<b>Варіант</b>	<b>Задача 1</b>	<b>Задача 2</b>
78.	3.2	2.28
79.	3.3	2.27
80.	4.1	3.7
81.	4.2	3.6
82.	1.2	2.25
83.	1.3	2.22
84.	1.4	2.20 (1-5)
85.	1.5	2.24
86.	1.6	2.28
87.	1.7	2.25
88.	1.9	2.21
89.	1.10	2.26
90.	1.11	2.24
91.	1.12	2.23
92.	3.3	2.27
93.	4.1	3.7
94.	4.2	3.6
95.	5.8	2.27
96.	5.7	2.26