

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 журналу відповідної групи.
2. Результати роботи слід оформити у вигляді **скріпленого надрукованого** документу обсягом 10-12 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).
3. Роботу слід вкласти до прозорого файлу разом з дискетою, що містить електронну версію роботи (разом з відповідним файлом в середовищі Mathematica), та здати викладачу **до 17.15 15 травня 2006 року**.

Групи «Фінанси» та «МЗЕД»

Завдання 1. Написати звіт про роботу та основні досягнення відомого економетриста. Слід зазначити його коротку біографію, основні праці, результати, їхнє застосування в сучасній економіці, здобуті нагороди (3-5 сторінок).

Завдання 2. Розв'язати вказані задачі з Навчально-методичного комплексу з курсу „Економетрика”.

Група «Менеджмент організацій» та «Облік і аудит»

Завдання 1. Написати реферат про суть, необхідність та структуру відповідного економетричного методу. (3-5 сторінок).

Завдання 2. Розв'язати вказані задачі з Навчально-методичного комплексу з курсу „Економетрика”.

Варіанти завдання 1 (Ф+МЗЕД)

1. Уотсон (Watson M.W.)
2. Чоу (Chow G.C.)
3. Роберт Солоу
4. Трюгве Хаавельмо
5. Лоуренс Клейн
6. Василий Леонтьев
7. Рагнар Фріш
8. Ян Тінберген
9. Фарр
- 10.Глаубер
- 11.Голдфельд (Goldfeld)
- 12.Квондт (Quandt)
- 13.Кочрейн (Cochrane)
- 14.Оркат (Orcutt)
- 15.Дарбін (Durbin)
- 16.Лу (Lu)
- 17.Рамсей (Ramsey)
- 18.Вінтерс (Winters)
- 19.Вінер (Wiener)
- 20.Вест (West M.)
- 21.Бреуш (Breush)
- 22.Паган (Pagan)
- 23.Кальман
- 24.Грейнджер (Granger C.W.J.)
- 25.Уайт (White)
- 26.Енгл (Engle R.F.)
- 27.Хілдрет (Hildreth C.)
- 28.Лукас (Lucas R.E.)
- 29.Стьюдент
- 30.Фішер
- 31.Грін В. (Greene W.)
- 32.Глейзер (Glejzer)
- 33.Вальд (Wald)
- 34.Рональд Коуз
- 35.Джон Нэш
- 36.Джеймс Тобін
- 37.Холт (Holt)
- 38.Бокс (Box)
- 39.Дженкінс (Jenkins)
- 40.Джеймс Хекман
- 41.Деніель Мак-Фадден

Варіанти завдання 1 (МО+ОА)

1. Засосування функції Хубера
2. Критерій Вальда
3. Тести Чоу
4. Процедура покрокового відбору змінних
5. Специфікація моделей
6. Метод максимальної правдоподібності для перевірки гіпотез
7. Оцінки вагів для зваженого методу найменших квадратів у формі Нев'є-Веста.
8. Тест Бреуша-Пагана (Breush-Pagan)
9. Інструментальні змінні
10. Аналітичні види тренду
11. Фільтр Кальмана
12. DSGE-моделі
13. RESET – тест
14. Триетапний метод найменших квадратів
15. Метод максимальної правдоподібності для оцінки регресій
16. Міри точності прогнозів
17. Модель пробіт (probit)
18. Модель логіт (logit)
19. Модель Тобіт
20. Моделі з панельними даними
21. Експертні методи прогнозування
22. Моделі Вінтерса
23. Проблема мультиколінеарності
24. Структурні макроекономічні моделі
25. Моделі множинного вибору
26. Тест Хаусмана
27. Методи Census X11 та Census X12
28. Нелінійний метод найменших квадратів
29. Узагальнений метод моментів для оцінки регресій
30. Методи експоненціального згладжування
31. Статистична обробка експертних оцінок
32. Методи оцінки погодженості думок між експертами
33. Оцінювання виробничо-інституціональних функцій

Варіанти завдання 2 (Ф+МЗЕД)

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

Варіант	Задача 1	Задача 2
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
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.	2.7	3.9

Варіанти завдання 2 (МО+ОА)

Варіант	Задача 1	Задача 2
1.	4.7	3.5
2.	5.9	3.4
3.	5.8	2.27
4.	5.7	2.26
5.	5.6	2.25
6.	5.5	2.24
7.	5.4	2.23
8.	5.3	2.22
9.	5.2	2.21
10.	5.1	2.20 (6-9)
11.	5.17	2.20 (1-5)
12.	5.16	2.19
13.	5.15	1.20
14.	5.14	1.19
15.	5.13	1.18
16.	5.12	1.17
17.	5.11	1.16

Варіант	Задача 1	Задача 2
18.	5.10	1.15
19.	4.1	3.6
20.	4.2	3.7
21.	4.3	3.8
22.	4.4	3.9
23.	4.5	3.10
24.	4.6	3.11
25.	3.1	2.22
26.	3.2	2.21
27.	3.3	2.20
28.	1.7	4.17
29.	1.8	4.16
30.	1.9	4.15
31.	5.5	2.19
32.	5.7	3.9
33.	5.2	2.22