

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 зведеному списку журналів груп «Менеджмент організацій» (варіанти 1-28), «Менеджмент ЗЕД» (29-54), «Фінанси 1» (55-81), «Фінанси 2» (82-94), «Облік і аудит» (95-105).
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 EViews.
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:
 - а. титульну сторінку (обов'язково слід вказати номер варіанту та прізвище виконавця);
 - б. виконані завдання роботи (кожне завдання має починатися з нової сторінки);
 - с. список використаної літератури (на окремій сторінці).
6. Роботу слід вкласти до прозорого файлу разом з **дискетою¹**, що містить електронну версію роботи (разом з відповідним файлом в середовищі EViews), та здати викладачу **до 17.35 21 травня 2007 року**. Роботи, здані після цієї дати, отримують оцінку 1.

¹ 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_07_Self". Реєстрація робіт проходить у автоматичному режимі, тому невиконання вимог призведе до втрати роботи.

Варіанти завдання 1

1. ARCH-моделі
2. DSGE-моделі
3. RESET – тест
4. Айвазян С.А.
5. Аль-Ош (Al-Osh M.)
6. Аналітичні види тренду
7. Анатольєв Станіслав
8. Бокс (Box)
9. Бреуш (Breush)
10. Вальд (Wald)
11. Васильєв Леонт'єв
12. Векторні авторегресійні системи (VAR)
13. Вест (West M.)
14. Використання волатильності у часових рядах
15. Вінер (Wiener)
16. Вінтерс (Winters)
17. Глаубер
18. Глейзер (Glejzer)
19. Голдфельд (Goldfeld)
20. Грейнджер (Granger C.W.J.)
21. Грін В. (Greene W.)
22. Дарбін (Durbin)
23. Деніель Мак-Фадден
24. Джеймс Тобін
25. Джеймс Хекман
26. Дженкінс (Jenkins)
27. Джон Нэш
28. Дігл П. (Diggle P.)
29. Діккі Д. (Dickey D.)
30. Економетрична модель LAM-3
31. Експертні методи прогнозування
32. Енгл (Engle R.F.)
33. Застосування функції Хубера
34. Інструментальні змінні
35. Кальман
36. Квондт (Quandt)
37. Коінтеграція та її застосування.
38. Кокс Д. (Cox D.)
39. Кочрейн (Cochrane)
40. Критерій Вальда
41. Лауреати Нобелівської премії за економетричні досягнення
42. Лоуренс Клейн
43. Лу (Lu)
44. Лукас (Lucas R.E.)

- 45.Метод максимальної правдоподібності для оцінки регресій
- 46.Метод максимальної правдоподібності для перевірки гіпотез
- 47.Методи Census X11 та Census X12
- 48.Методи експоненціального згладжування
- 49.Методи оцінки погодженості думок між експертами
- 50.Міри точності прогнозів
- 51.Моделі Вінтерса
- 52.Моделі з лаговими змінними.
- 53.Моделі з панельними даними
- 54.Моделі зі змінною дисперсією
- 55.Моделі множинного вибору
- 56.Модель логіт (logit)
- 57.Модель пробіт (probit)
- 58.Модель Тобіт
- 59.Нелінійний метод найменших квадратів
- 60.Оркат (Orcutt)
- 61.Орлов А.І.
- 62.Оцінка систем одночасних регресійних рівнянь. Ідентифікація моделей.
- 63.Оцінка систем регресійних рівнянь.
- 64.Оцінки вагів для зваженого методу найменших квадратів у формі Нев'є-Веста.
- 65.Оцінювання виробничо-інституціональних функцій
- 66.Паган (Pagan)
- 67.Проблема мультиколінеарності
- 68.Прогнозний критерій Чоу
- 69.Процедура покрокового відбору змінних
- 70.Процеси авторегресії зі змінною дисперсією.
- 71.Рагнар Фріш
- 72.Рамсей (Ramsey)
- 73.Роберт Солоу
- 74.Рональд Коуз
- 75.Специфікація моделей
- 76.Статистична обробка експертних оцінок
- 77.Структурні макроекономічні моделі
- 78.Структурні розриви. Бінарні змінні.
- 79.Структурні розриви. Нелінійність у змінних.
- 80.Структурні розриви. Тестування на структурні розриви.
- 81.Стьюdent
- 82.Тест Бреуша-Пагана (Breush-Pagan)
- 83.Тест Кокса.
- 84.Тест Хаусмана
- 85.Тести на стабільність моделі.
- 86.Тести Чоу
- 87.Тестування на автокореляцію.
- 88.Тестування на наявність коінтеграції.
- 89.Тестування нелінійних обмежень

90. Триетапний метод найменших квадратів
91. Трюгве Хаавельмо
92. Уайт (White)
93. Узагальнений метод моментів для оцінки регресій
94. Уотсон (Watson M.W.)
95. Фарр
96. Фільтр Кальмана
97. Фільтр Ходріка-Прескотта
98. Фішер
99. Флетчер М. (Fletcher M.)
100. Хілдрет (Hildreth C.)
101. Холт (Holt)
102. Чоу (Chow G.C.)
103. Шмідт П. (Schmidt P.)
104. Ян Тінберген
105. VAR-моделі

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

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.	4.7	3.5
42.	5.9	3.4

Варіант	Задача 1	Задача 2
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
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

Варіант	Задача 1	Задача 2
75.	2.14	3.9
76.	2.15	3.8
77.	3.1	2.26
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
97.	4.7	3.5
98.	5.9	3.4
99.	5.8	2.27
100.	5.7	2.26
101.	5.6	2.25
102.	2.11	4.15
103.	2.12	4.16
104.	2.13	4.17
105.	2.14	3.9