

БИЛЕТ	УЧЕБНИК	ЛЕКЦИИ	ТЕОРИИ, ТЕХ	ТЕОРИИ, 2К17	ТЕОРИИ
1. Основные задачи многомерного статистического анализа.		21-24	1	1	1. Основные задачи многомерного статистического анализа.
2. Гильбертово пространство случайных величин. Задача о наилучшей линейной оценке.	117-123	1-5	2, 3, 4	2, 3, 4	2. Гильбертово пространство случайных величин.
3. Корреляционный и регрессионный анализ.	14-16				3. Что такое наилучшая линейная оценка.
4. Коэффициенты корреляции.	17-29	5-14	5, 6, 7	5, 6, 7	4. Лемма о перпендикулярности.
5. Простая линейная регрессия. Метод наименьших квадратов. Свойства оценок.	31-41				5. Простой коэффициент корреляции и что он измеряет.
6. Множественная линейная регрессия. МНК. Свойства оценок.	52-60	25-32	8, 9, 10	8, 9, 10, 11	6. Множественный коэффициент корреляции и что он измеряет.
7. Т-критерий значимости влияния фактора.	63-65	35-36	12	13	7. Частный коэффициент корреляции и что он измеряет.
8. Проверка линейных гипотез. F-критерий.	65-68	36-38	13	14	8. Множественная линейная регрессия: модель и основные ограничения.
9. Проверка адекватности модели. Коэффициент детерминации.	69-71	39-41	14, 15	15, 16	9. Описание МНК для оценки параметров.
10. Равенство уравнений регрессии. Тест Чоу.	81-84	41-42			10. Явный вид оценок параметров по МНК.
11. Фиктивные переменные.	86-89	44-46			11. Явный вид оценки для дисперсии ошибки.
12. Модель линейной регрессии с гетероскедастичностью.	99-103	21-23		20	12. Общая схема проверки гипотезы о параметре.
13. Модель линейной регрессии с автокорреляцией в ошибках. Критерий Дарбина-Уотсона.	107-108 110-112	23-25		22, 23	13. Для чего используется Т-критерий.
14. Модели бинарного выбора. Логит и пробит модели.		25-27		17, 18, 19	14. Основное различие Т-критерия и F-критерия в задаче проверки значимости влияния фактора.
15. Однофакторный дисперсионный анализ.	4-6	47-50	16	24	15. Адекватность модели. Постановка задачи.
16. Двухфакторный дисперсионный анализ.	7-9	53-55	17	25	16. Коэффициент детерминации и что он измеряет.
17. Дискриминантный анализ: постановка задачи и ее решение в случае известных параметров.		57-64	18	26	17. Описание модели бинарного выбора.
18. Решение задачи дискриминантного анализа в случае неизвестных параметров.		64-66			18. Логит-модель.
19. Кластерный анализ: постановка задачи и основные понятия.	1-4	67-68	19	27	19. Пробит-модель.
20. Кластерный анализ: схема последовательного построения факторов.	5	68-69	20	28	20. Что такое модель с гетероскедастичностью.
	44-45		11	12	21. Введенный МНК.
	95-98	20-21		21	22. Описание модели с автокорреляцией первого порядка в ошибках.
					23. Что проверяет тест Дарбина-Уотсона.
					24. Модель и основная задача в однофакторном дисперсионном анализе.
					25. Модель и основная задача в двухфакторном дисперсионном анализе.
					26. Основная задача дискриминантного анализа.
					27. Кластерный анализ: постановка задачи.
					28. Кластерный анализ: последовательное построение кластеров.