

# Англо-русский эконометрический словарь

[A](#) [B](#) [C](#) [D](#) [E](#) [F](#) [G](#) [H](#) [I](#) [J](#) [K](#) [L](#) [M](#) [N](#) [O](#) [P](#) [Q](#) [R](#) [S](#) [T](#) [U](#) [V](#) [W](#) [Y](#) [Z](#)

## А

[a posteriori](#) апостериори || апостериорный (↔ [posterior](#))

[a priori](#) априори || априорный (↔ [prior](#)) {bound, estimate, information, restriction}

[accuracy](#) точность

[accept](#) принимать {hypothesis}

[actual](#) действительный, фактический {value}

[addition](#)

**variable** ~ добавление переменных {test}

[adaptive](#) адаптивный {expectations}

[additive](#) аддитивный

[additivity](#) аддитивность

[adequacy](#) адекватность, соответствие

**~ of forecast** адекватность предсказаний

**model** ~ адекватность модели

[adjust](#) приспособливать, приводить в соответствие, корректировать

[adjustment](#) приспособление, корректировка, исправление (см. т.ж. **correction**)

**bias** ~ корректировка смещения

**partial** ~ частичное приспособление

**instantaneous** ~ мгновенное приспособление

**seasonal** ~ корректировка на сезонность

admissible допустимый

aggregate совокупный, агрегированный || совокупная величина, агрегированная величина, агрегат

aggregation агрегирование

**time** ~ агрегирование по времени???

algebra алгебра

**matrix** ~ матричная алгебра, алгебра матриц

algorithm алгоритм

**Cochran-Orcutt** ~ алгоритм Кочрена-Оркатта

**conjugate directions** ~ алгоритм сопряженных направлений

alternative альтернатива || альтернативный {hypothesis}

**local** ~ локальная альтернатива

analyse (analyze) анализировать, исследовать

analysis анализ

~ **of covariance** ковариационный анализ

~ **of variance** дисперсионный анализ

**canonical** ~ канонический анализ

**cluster** ~ кластерный анализ

**common factor** ~ общий множитель ???

**confluence** ~ конфлюэнтный анализ

**correspondence** ~ анализ соответствий

**data** ~ анализ данных

**discriminant** ~ дискриминантный анализ

**dynamic** ~ динамический анализ

**factor** ~ факторный анализ

**longitudinal** ~ продольный??? анализ, изучение явления в различные моменты времени

**multivariate** ~ многомерный анализ

**spectral** ~ спектральный анализ

annual годовой, ежегодный

anticipate предвидеть

antithetic противоположный, дополнительный, дополняющий {*variate*}

approach подход

**Bayesian** ~ байесовский подход

approximation аппроксимация, приближение, оценка

**asymptotic** ~ асимптотическая аппроксимация

**stochastic** ~ стохастическая аппроксимация

area площадь

arrangement расположение, конфигурация (напр., точек плана)

association связь, зависимость, ассоциация

assumption предположение, допущение

**tentative** ~ предварительное, пробное предположение

asymptotic (al) асимптотический {*approximation, bias, distribution, efficiency, equivalence, equivalent, standard error, expansion, identifiability, covariance matrix, normality, power, properties, test, theory, unbiasedness, value, variance*}

asymptotically асимптотически {*equivalent, normal*}

augment увеличивать, прибавлять

augmented дополненный {*Dickey-Fuller test*}

augmentation увеличение, прирост, приращение

autocorrelation автокорреляция, сериальная корреляция {*consistent, correction, function, test*}

**partial** ~ частная автокорреляция {*function*}

**residual** ~ автокорреляция остатков

**spatial** ~ пространственная автокорреляция

autocorrelogram автокоррелограмма

autocovariance автоковариация

autonomous автономный ( **exogenous**) {factor}

autoregression авторегрессия  **of n-th order** авторегрессия n-го порядка  
{model}

**order of** ~ порядок авторегрессии

**vector** ~ векторная авторегрессия

autoregressive авторегрессионный {moving average, errors, conditional heteroscedasticity, distributed lag, least squares, model, process, scheme}

auxiliary вспомогательный, дополнительный {regression}

average среднее || средний (См. тж. **mean**) {value}

**arithmetic** ~ среднее арифметическое

**autoregressive moving** ~ авторегрессионное скользящее среднее (См. **autoregression**???)

**geometric** ~ среднее геометрическое

**moving** ~ скользящее среднее

**simple** ~ простое среднее ( среднее арифметическое, невзвешенное)

**weighted** ~ взвешенное среднее

## B

backward обратный || назад, в обратном направлении

badness

~ of fit ( **lack of fit, poor fit**) плохой подбор, неадекватность

band полоса, полоса частот {chart, spectrum}

**error** ~ интервал между доверительными границами???

bandwidth ширина полосы, ширина окна {selection}

~ of a window ширина окна

base базисный, базовый {period}

**behavior** поведение, динамика (экономического показателя)

**belief** убеждение, мнение, доверие {degree of ~ }

**prior believes** априорные предположения, априорные убеждения

**benchmark** эталон, точка отсчета, база

**best** лучший, наилучший, оптимальный {(linear unbiased) estimator}

**bias** смещение, систематическая ошибка {adjustment, correction}

**asymptotic** ~ асимптотическое смещение

**downward** ~ занижение, смещение вниз

**selection** ~  **selectivity** ~

**selectivity** ~ смещение из-за отбора наблюдений

**simultaneity** ~ смещение из-за одновременности ???

**simultaneous equations** ~  **simultaneity** ~

**upward** ~ завышение, смещение вверх

**biased** смещенный (См. тж. **unbiased**) {estimate, estimation, prediction, sample}

**severely** ~ сильно смещенный

**binary** бинарный, двоичный {choice, variable}

**binomial** биномиальный || бином, двучлен {(negative) ~ distribution}

**biometrics** биометрика, биометрия

**bivariate** двумерный {normal distribution}

**block** блок

**block-diagonal** блочно-диагональный {matrix}

**bootstrap** бутстреп || проводить бутстреп? ??

**bootstrapping** проведение бутстрепа, анализ с помощью,...???

**bound** граница, грань

**a priori** ~ априорная граница

**confidence** ~ доверительная граница

**Cramer-Rao** ~ граница Крамера-Рао

**lower** ~ нижняя граница

**upper** ~ верхняя граница

**bounded** ограниченный {variance}

**Box-Jenkins** относящийся к методу Бокса-Дженкинса {model}

**break-point** перелом, точка изменения тенденции {test}

**bubble** [спекулятивный] пузырь

**building**

**model** ~ построение модели, моделирование

## C

**calculation** вычисление, расчет

**causal** причинный {chain, mechanism}

**causality** причинность

**instantaneous** ~ мгновенное (одновременное) причинное воздействие

**Granger** ~ причинность по Грейнджеру

**causation** причинность, причинение

**cell** клетка, ячейка

**censored** цензурированный {distribution, regression, sample}

**censoring** цензурирование

**double** ~ двойное цензурирование

**census** перепись

**centile** процентиль

**center** (амер.  **centre**)

**centre** центр || центрировать

centred центрированный

chain цепь, цепочка

**causal** ~ причинная цепочка

**Markov** ~ цепь Маркова, марковская цепь

change изменение, прирост

**structural** ~ структурные изменения

characteristic характеристический {function, polynomial}

chart диаграмма, карта, схема

**band** ~ ленточная диаграмма

**bar** ~ столбцовая диаграмма

checking проверка

**diagnostic** ~ диагностическая проверка

chi-square хи-квадрат {distribution, test}

choice выбор {criterion}

**binary** ~ бинарный выбор {model}

**discrete** ~ дискретный выбор {model}

**model** ~ выбор модели

**multiple** ~ множественный выбор

Chow-test  Chow test

circular круговой, циклический

classification классификация, группировка

**one-way** ~ односторонняя классификация, классификация по одному признаку

**two-way** ~ двусторонняя классификация, классификация по двум признакам

classifier классификатор???

clitic клитический, относящийся к асимметрии

closed замкнутый

cluster кластер, скопление, группа {analysis}

clustering разбиение совокупности на гнезда (Math-E)

coefficient коэффициент (См. тж. **parameter**) {standard error, random ~s model}

~ **of determination** коэффициент детерминации

~ **of determination adjusted for degrees of freedom** коэффициент детерминации скорректированный на количество степеней свободы

~ **of variation** коэффициент вариации

**adjusted ~ of determination** скорректированный коэффициент детерминации (☐)  
~ **of determination adjusted for degrees of freedom**)

**beta** ~ коэффициент бета (☐ **regression** ~ )

**correlation** ~ коэффициент корреляции

**multiple correlation** ~ коэффициент множественной корреляции

**regression** ~ коэффициент регрессии

**sample correlation** ~ выборочный коэффициент корреляции

**skewness** ~ коэффициент асимметрии

**slope** ~ угловой коэффициент, коэффициент наклона

**Spearman's rank correlation** ~ коэффициент ранговой корреляции Спирмена

coherence когерентность, согласованность

cointegrated коинтегрированный {process, variables}

cointegrating коинтегрирующий {combination, relationship, transformation, vector}

cointegration коинтеграция {order, rank, restriction, space, test, vector}

collection

**data** ~ сбор данных

collinearity коллинеарность

combination комбинация, сочетание



**cointegrating** ~ коинтегрирующая комбинация

complement

**orthogonal** ~ ортогональное дополнение

component компонента, составная часть, составляющая, член

**cyclic(al)** ~ циклическая составляющая (□|**harmonic** ~ )

**harmonic** ~ гармоническая составляющая

**orthogonal ~s** ортогональные компоненты

**principal ~s** главные компоненты

**smooth** ~ гладкая составляющая

compound составной, сложный || смесь

concentration концентрация, кучность

condition условие || обуславливать, обусловить, рассматривать условное распределение {number}

**equilibrium** ~ условие равновесия

**moment ~s** ??? условия для моментов

**normalizing** ~ условие нормализации, условие нормировки

**order** ~ ???

**orthogonality** ~ условие ортогональности

**rank** ~ ???

**stability** ~ условие устойчивости

**stationarity** ~ условие стационарности

conditional условный {density, distribution, expectation, factorization, forecast, (autoregressive) ~ heteroscedasticity, independence, moment, probability, variance}

conditioned обусловленный

**poorly** ~ плохо обусловленный

confidence доверие || доверительный {bound, ellipsoid, (non-central) ~ interval, level, limit, (joint) ~ region}

confirmation подтверждение, подкрепление

confounding смешивание, смешение

congruency соответствие

congruent подходящий, соответствующий, гармонирующий {model}

conjecture догадка, предположение

conjugate сопряженный {~ directions algorithm}

consistency состоятельность, непротиворечивость

consistent состоятельный {estimator, test}

**autocorrelation** ~ состоятельный при автокорреляции

**heteroscedasticity** ~ состоятельный при гетероскедастичности

**root-n** ~ состоятельный???

**super** ~ сверхсостоятельный

constancy неизменность, постоянство

**parameter** ~ постоянство параметров {test}

constant константа (См. тж. **intercept**), постоянная || постоянный {term}

constrained ограниченный, условный (об оптимизации) {optimization}

constraint ограничение ( $\square$  **restriction**)

contaminated “загрязненный”

contingency сопряженность признаков, случайность, случай {table}

contrast контраст (spravoch)??? (Green)

contribution вклад

converge сходиться (См. тж. **convergence**)

convergence сходимость {rate of ~ }

~ **in distribution** сходимость по распределению

~ **in law** сходимость по ?? ( $\square$  ~ **in distribution**)

**~ in mean square** сходимость в среднеквадратическом

**~ in probability** сходимость по вероятности

**almost sure** ~ сходимость почти наверное

**quadratic** ~ квадратичная сходимость

**stochastic** ~ стохастический, случайный??? (☐ ~ in probability)

convergent сходящийся

correction поправка, исправление, корректирование (См. тж. **adjustment**)

**autocorrelation** ~ поправка на автокорреляцию

**bias** ~ поправка на смещение

**continuity** ~ поправка на непрерывность

**degrees of freedom** ~ поправка на количество степеней свободы

**equilibrium** ~ поправка равновесие ???

**error** ~ исправление ошибки {mechanism, model, term}

**grouping** ~ поправка на группировку

**size** ~ корректировка размера (критерия)???

correlated коррелированный {process, sampling}

**serially** ~ сериально коррелированный

correlation корреляция {( multiple, sample) ~ coefficient, matrix}

**canonical** ~ каноническая корреляция

**multiple** ~ множественная корреляция. множественный коэффициент корреляции

**rank** ~ ранговая корреляция {measure, Spearman's ~ coefficient}

**simple** ~ простая корреляция

**serial** ~ сериальная корреляция

**spurious** ~ ложная корреляция

correlogram коррелограмма

**partial** ~ частная коррелограмма, график частной автокорреляционной функции

**residual** ~ коррелограмма остатков

correspondence соответствие, аналогия, соотношение {analysis}

co-spectral ко-спектральный

co-spectrum ко-спектр

covariance ковариация, смешанный второй центральный момент {analysis of ~ , ~ generating function, (asymptotic, Newey-West, White) ~ matrix, stationary}

**instantaneous** ~ ковариация между одновременными переменными

criterion критерий

**Akaike information** ~ информационный критерий Акаике

**Amemiya's prediction** ~ предсказательный критерий Амемии???

**choice** ~ критерий выбора

**information** ~ информационный критерий

**fitting** ~ критерий подгонки

**Schwartz information** ~ информационный критерий Шварца

critique критика

**Lucas** ~ критика Лукаса

cross- перекрестный, взаимный

cross-classification перекрестная классификация

cross-correlation кросс-корреляция, перекрестная корреляция

cross-covariance кросс-ковариация, перекрестная ковариация

cross-elasticity перекрестная эластичность

cross-equation ???

cross-plot  scatter

cross-product взаимодействие (парное); ~s попарные произведения

cross-section (о данных) срез, одномоментная выборка, данные по совокупности исследуемых единиц??? || относящийся к одному моменту времени

**~ of time-series** ???

cross-spectrum кросс-спектр

cross-validation кросс-проверка

cumulant семиинвариант, полуинвариант

cumulative кумулятивный, интегральный, накопленный {distribution, distribution function, (sum, sum of squares) test}

curve кривая

**logistic** ~ логистическая кривая

**regression** ~ регрессионная кривая

**smooth** ~ гладкая кривая

cycle цикл

cyclic(al) циклический, периодический {component, trend}

## D

data данные

**count** ~ счетные, дискретные данные

**categorized** ~ категоризованные данные

**differenced** ~ разности исходных данных

**grouped** ~ сгруппированные данные

**input** ~ входные данные, исходные данные

**integrated** ~ интегрированные данные

**longitudinal** ~ продольные??? данные, данные продольного анализа ???

**missing** ~ пропущенные, отсутствующие данные

**noisy** ~ зашумленные данные (измеренные с большими ошибками)

**ordered** ~ упорядоченные данные

**original** ~ исходные данные

**panel** ~ ???

**pooled** ~ объединенные данные???

**proportions** ~ данные о пропорциях???

**raw** ~ необработанные данные, “сырые” данные

**ranked** ~ упорядоченные данные

**sample** ~ выборочные данные

**survival** ~ данные о продолжительности???

data-based основывающийся на данных {expectations}

data-set (См. data set)

dating датировка

decile дециль

decomposition разложение

**Cholesky** ~ разложение Холецкого

**orthogonal** ~ ортогональное разложение

**QR** ~ QR-разложение

**singular value** ~ разложение???

**spectral** ~ спектральное разложение

**square root** ~ разложение квадратного корня

**sum of squares** ~ разложение суммы квадратов

**triangular** ~ треугольное разложение, триангуляризация???

**Wold** ~ разложение Вольда

definition определение

deflate дефлировать, выражать в постоянных ценах

deflator дефлятор (индекс цен)

degenerate вырожденный {distribution}

degree степень, порядок, градус

~ **of accuracy** степень точности

~ **of belief** степень уверенности, степень доверия

**~ of dependence** степень зависимости

**~s of freedom** степени свободы, количество степеней свободы {coefficient of determination adjusted for ~ , correction}

## deletion

**variable** ~ удаление переменных {test}

density плотность, плотность распределения {(spectral) ~ function}

**conditional** ~ условная плотность распределения, плотность условного распределения

**joint** ~ плотность совместного распределения???

**marginal** ~ маргинальная плотность

**multivariate** ~ многомерная плотность

**normal** ~ плотность нормального распределения

**prior** ~ априорная плотность распределения

**posterior** ~ апостериорная плотность распределения

**probability** ~ плотность вероятности

**spectral** ~ спектральная плотность

dependence зависимость {degree of ~ }

**linear** ~ линейная зависимость

dependent зависимый {(limited, qualitative) ~ variable}

derivative производная

**numerical** ~ численная производная

deseasonalize удалять сезонность, очищать от сезонной составляющей

design план (эксперимента), конструкция

**~ of experiments** планирование экспериментов

**balanced** ~ уравновешенный план

**factorial** ~ факторный план

**incomplete** ~ неполный план

**orthogonal** ~ ортогональный план

**random** ~ случайный план, рандомизированный план

detect обнаруживать

determinant определитель, детерминант

deterministic детерминированный {trend, variable}

detrending удаление тренда

deviance сумма квадратов отклонений выборочных значений от их среднего, девиация, или отклонение

deviate отклонение, случайная величина???

deviation отклонение

**absolute** ~ абсолютное отклонение

**least absolute** ~ [method] метод наименьших модулей (абсолютных отклонений)

**standard** ~ стандартное отклонение, среднеквадратическое отклонение

diagnostic диагностический {checking, test}

diagnostics диагностика, диагностическая статистика

diagonal диагональный || диагональ {matrix}

**principal** ~ главная диагональ

diagonalization диагонализация (матрицы), приведение к диагональному виду

diagram диаграмма, график

**scatter** ~ диаграмма рассеяния ( scatter)

dichotomous дихотомический {variable}

difference разность, приращение, разница, различие {operator, stationary}

differencing вычисление разности, взятие разности {operator, test}

differentiation дифференцирование

**matrix** ~ матричное дифференцирование

**vector** ~ векторное дифференцирование



dimension размерность

dimensionality размерность

disaggregated дезагрегированный

disaggregation дезагрегация, разбивка

discard отбрасывать

discrepancy расхождение, различие, невязка

discrete дискретный {choice, distribution, variable}

discriminate различать, распознавать

discrimination различение, дискриминация

disequilibrium неравновесие, нарушение равновесия || неравновесный

dispersion дисперсия, рассеяние {matrix}

distance расстояние {matrix}

**least ~ [method]** метод наименьших расстояний

**Mahalanobis ~** расстояние Махаланобиса

distortion искажение

**size ~** искажение размера (критерия)

distribution распределение {convergence in ~ , (cumulative, inverse) ~ function, family of ~s , mixture of ~s }

**asymptotic ~** асимптотическое распределение

**bell-shaped ~** колоколообразное распределение

**Bernoulli ~** распределение Бернулли

**beta ~** бета-распределение

**bimodal ~** бимодальное распределение, двухвершинное распределение

**binomial ~** биномиальное распределение

**bivariate normal ~** двумерное нормальное распределение

**chi-square(d) ~** распределение хи-квадрат

**Cauchy** ~ распределение Коши

**censored** ~ цензурированное распределение

**conditional** ~ условное распределение

**continuous** ~ непрерывное распределение

**cumulative ~ [function]** [кумулятивная, интегральная] функция распределения

**degenerate** ~ вырожденное распределение

**discrete** ~ дискретное распределение

**empiric(al)** ~ эмпирическое распределение

**Erlang** ~ распределение Эрланга

**exponential** ~ экспоненциальное распределение

**extreme value** ~ распределение экстремального значения

**F** ~ F-распределение

**Fisher** ~ распределение Фишера

**frequency** ~ эмпирическое распределение (ЭкТеор)

**gamma** ~ гамма-распределение

**Gaussian** ~ гауссово распределение

**geometric** ~ геометрическое распределение

**Haavelmo** ~ ???

**hypergeometric** ~ гипергеометрическое распределение

**inverse** ~ обратная функция распределения

**joint** ~ совместное распределение

**Laplace** ~ распределение Лапласа

**large-sample** ~ распределение в больших выборках

**limiting** ~ предельное распределение

**logistic** ~ логистическое

**lognormal** ~ логнормальное распределение

**marginal** ~ маргинальное распределение, безусловное частное распределение

**mixing** ~ смешанное распределение???

**multimodal** ~ мультимодальное распределение, многовершинное распределение

**multinomial** ~ мультиномиальное распределение???, полиномиальное распределение

**multivariate** ~ многомерное распределение

**multivariate normal** ~ многомерное нормальное распределение

**negative binomial** ~ отрицательное биномиальное распределение

**non-central** ~ нецентральное распределение

**normal** ~ нормальное распределение

**Pearson** ~ распределение Пирсона, распределение из пирсоновского семейства

**Poisson** ~ распределение Пуассона

**posterior** ~ апостериорное распределение

**prior** ~ априорное распределение

**sample** ~ выборочное распределение

**small-sample** ~ распределение в малых выборках

**Student** ~ распределение Стьюдента

**symmetric** ~ симметричное распределение

**t** ~ t-распределение

**unconditional** ~ безусловное распределение

**uniform** ~ равномерное распределение

**unimodal** ~ унимодальное распределение, одновершинное распределение

**Weibull** ~ распределение Вейбулла

**Wishart** ~ распределение Уишарта

distribution-free свободный от распределения {method, model}

disturbance возмущение (☐ error)

**non-spherical ~s** несферические возмущения (☐ heteroscedasticity)

**random** ~ случайное возмущение

**spherical ~s** сферические возмущения ( **homoscedasticity**)

divergence ~ расхожимость

domain область

~ **of function** область определения функции

**frequency** ~ частотная область

**time** ~ временная область

downward направленный или движущийся вниз, убывающий {**bias, trend**}

draw тянуть, бросать (жребий), генерировать (случайные числа) || жребий  **no ~ sample**  
делать выборку, генерировать выборку

drawing извлечение, выбор ( **sampling**), чертеж

~ **with replacement** выбор с возвращением

drift тенденция, снос, дрейф {**random walk with ~** }

**upward** ~ тенденция к росту

dummy [variable] фиктивная переменная

**seasonal** ~ сезонная фиктивная переменная

duration продолжительность, длительность {**model**}

dynamic динамический {**analysis, forecast, model, multiplier, regression, specification, system**}

dynamics динамика

**system** ~ системная динамика, динамика системы

## E

econometric эконометрический {**tools**}

econometrician эконометрик

econometrics эконометрика, эконометрия

effect эффект, результат, следствие, влияние

**end** ~ граничный эффект, концевой эффект

**fixed ~s** фиксированные эффекты (в дисперсионном анализе) {model}

**lagged** ~ запаздывающий, отложенный эффект/влияние

**long-run** ~ долгосрочный эффект

**random ~s** случайные эффекты (в дисперсионном анализе) {model}

**seasonal** ~ сезонный эффект

**short-run** ~ краткосрочный эффект

efficiency эффективность {gain, loss of ~ }

**asymptotic** ~ асимптотическая эффективность

**asymptotic relative** ~ относительная асимптотическая эффективность

efficient эффективный {estimation, estimator, score, test}

**one-step** ~ одношаговый эффективный {estimator}

eigen-value собственное число, собственное значение

eigen-vector собственный вектор

elasticity эластичность

**cross** ~ перекрестная эластичность

**unit** ~ единичная эластичность

elimination исключение

ellipsoid эллипсоид

**confidence** ~ доверительный эллипсоид

embed вкладывать, погружать

embedding вложение

empiric(al) эмпирический, полученный из опыта,  выборочный {distribution, evidence, law}

encompass охватывать

encompassing охват {principle, test}

**parsimonious** ~ экономный охват

endogeneity эндогенность

endogenous эндогенный, внутрисистемный (См. тж. **exogenous**) {variable}

equation уравнение {set of ~s}

**estimator-defining** ~ уравнение, задающее оценки???

**estimator-generating** ~ уравнение, порождающее оценки???

**likelihood ~s** уравнения правдоподобия

**moment ~s** уравнения для моментов ???

**normal ~s** нормальные уравнения

**recurrence ~s** рекуррентные уравнения

**regression** ~ уравнение регрессии

**simultaneous ~s** система одновременных уравнений

**Yule-Walker ~s** уравнения Юла-Уолкера

equicorrelated равнокоррелированный???

equilibrium равновесие {condition, error}

equivalence эквивалентность, равносильность

**asymptotic** ~ асимптотическая эквивалентность

**observational** ~ эквивалентность с точки зрения наблюдений, неотличимость

equivalent эквивалентный, равносильный || эквивалент

**asymptotic(al)** ~ асимптотический эквивалент

**asymptotically** ~ асимптотически эквивалентный

**locally** ~ локально эквивалентный

**observationally** ~ эквивалентный с точки зрения наблюдений??, неотличимый


equivariant эквивариантный??

equivariance эквивариантность;??

ergodic эргодический {process, sequence, time series}

ergodicity эргодичность

erroneous ошибочный, ложный

error ошибка  **due to ...** ошибка, обусловленная ... {band, correction, space, variance}

**~s in variables** ошибки в переменных

**autoregressive ~s** авторегрессионные ошибки

**asymptotic standard ~** асимптотическая стандартная ошибка

**coefficient standard ~** стандартная ошибка коэффициента

**equilibrium ~** отклонение от равновесия, ???

**forecast ~** ошибка прогноза

**mean-root-square ~** среднеквадратическая ошибка ???

**mean-square ~** среднеквадратическая ошибка, средний квадрат ошибки ???

**measurement ~** ошибка измерения

**moving-average ~s** ошибки типа скользящего среднего ???

**observation(al) ~** ошибка наблюдения

**predictive (prediction) ~** ошибка предсказания ( **forecast ~** )

**random ~** случайная ошибка

**rounding ~** ошибка округления

**sample ~** выборочная ошибка

**specification ~** ошибка спецификации

**standard ~** стандартная ошибка (, среднеквадратическая ошибка ???)

**systematic ~** систематическая ошибка

**type I ~** ошибка первого рода

**type II ~** ошибка второго рода

**white noise ~s** белый шум ???

establish устанавливать

established установленный

estimable допускающий оценивание, поддающийся оценке

estimand оцениваемая величина

estimate оценка || оценивать  **to estimate recursively** оценивать рекуррентно

**a priori** ~ априорная оценка

**approximate** ~ приближенная оценка

**biased** ~ смещенная оценка

**Bayes** ~ байесовская оценка

**exact maximum likelihood** ~ оценка точного метода максимального правдоподобия

**maximum likelihood** ~ оценка максимального правдоподобия

**non-parametric** ~ непараметрическая оценка

**point** ~ точечная оценка

**regression** ~ регрессионная оценка

**restricted** ~ ограниченная оценка, оценка с ограничениями

**sample** ~ выборочная оценка

**semiparametric** ~ полупараметрическая оценка

**subjective** ~ субъективная оценка

**unbiased** ~ несмещенная оценка

**unrestricted** ~ ???

estimated оцененный {value}

estimating оценивающий, оценочный

estimation оценивание {method, period, space, technique}

**biased** ~ смещенное оценивание

**Bayesian** ~ байесовское оценивание

**efficient** ~ состоятельное оценивание



**interval** ~ интервальное оценивание

**linear** ~ линейное оценивание

**kernel** ~ ядерное оценивание

**maximum likelihood** ~ оценивание методом максимального правдоподобия

**mixed** ~ смешанное оценивание

**non-linear** ~ нелинейное оценивание

**non-parametric** ~ непараметрическое оценивание

**parameter** ~ оценивание параметров

**parametric** ~ параметрическое оценивание

**point** ~ точечное оценивание

**recursive** ~ рекурсивное оценивание

**semiparametric** ~ полупараметрическое оценивание

**estimator** способ оценивания, метод оценивания, оценка, оцениватель

**Aitken** ~ метод оценивания Эйткена (□ **generalized least squares** ~)

**best** ~ наилучшая оценка

**best linear unbiased** ~ (BLUE) наилучшая линейная несмещенная оценка

**consistent** ~ состоятельная оценка

**efficient** ~ эффективная оценка

**generalized least squares** ~ оценка обобщенного метода наименьших квадратов

**inconsistent** ~ несостоятельная оценка

**instrumental variable** ~ оценка метода инструментальных переменных

**K-class** ~ ??? оценка К-класса

**linear** ~ линейная оценка

**minimum expected loss** ~ оценка, минимизирующая ожидаемые потери???

**minimum-variance** ~ оценка с минимальной дисперсией

**minimum-variance unbiased** ~ несмещенная оценка с минимальной дисперсией

**Newey-West [autocorrelation consistent]** ~ [состоятельная при автокорреляции] оценка Ньюи-Уэста

**one-step efficient** ~ одношаговая эффективная оценка

**pre-test** ~ ???

**single equation** ~ метод оценивания одного уравнения (из системы одновременных уравнений)

**system** ~ системный метод оценивания (для всей системы одновременных уравнений в целом)

**unbiased** ~ несмещенная оценка

??? **autocorrelation** ~

**White [heteroscedasticity consistent]** ~ [состоятельная при гетероскедастичности] оценка Уайта???

event событие, исход

**independent ~s** независимые события

**null** ~ событие с нулевой вероятностью

**random** ~ случайное событие

evidence основание, данные, признак, свидетельство, доказательство

**empiric(al)** ~ эмпирические данные

ex ante??

ex post??

exact точный {maximum likelihood estimate, test}

exclusion исключение

exogenous экзогенный, определяемый извне, внешний по отношению к модели (не моделируемый), внешний по отношению экономической системе, внесистемный {factor, variable}

exogeneity экзогенность

**strict** ~ строгая экзогенность??

**strong** ~ сильная экзогенность

**super** ~ сверхэкзогенность

**weak** ~ слабая экзогенность

expansion разложение


**asymptotic** ~ асимптотическое разложение

**Edgeworth** ~ разложение Эджворта

**serial** ~ разложение в ряд

**stochastic** ~ стохастическое разложение

**Taylor** ~ разложение в ряд Тейлора, разложение Тейлора

expectation ожидание, математическое ожидание, первый момент  **s formation**  
формирование ожиданий {~s lag, operator}

**adaptive ~s** адаптивные ожидания

**conditional** ~ условное [математическое] ожидание

**data-based ~s** ожидания, основанные на данных

**backward-looking ~s** ретроспективные (основанные на прошлом опыте) ожидания

**rational ~s** рациональные ожидания

**regressive ~s** регрессивные ожидания, возвратные?? ожидания

**static ~s** статические ожидания

**unconditional** ~ безусловное [математическое] ожидание

**unbiased** ~ несмещенные ожидания

expected ожидаемый {value}

experiment эксперимент, опыт {design of ~s }

**Monte-Carlo** ~ эксперимент Монте-Карло

**factorial** ~ факторный эксперимент

exponential экспоненциальный, показательный {distribution, family, lag, smoothing, trend}

extent размер, протяжение, степень

extrapolation экстраполяция, экстраполирование

extremum экстремум

## F

F-distribution F-распределение (Фишера)

factor фактор (☐, regressor), множитель, коэффициент {analysis, loading}

**autonomous** ~ автономный фактор (☐, exogenous ~ )

**common** ~ общий множитель {analysis, restriction, test}

**exogenous** ~ экзогенный фактор

**scale** ~ масштабный множитель

factorial факторный {design, experiment} || факториал

factoring разложение на множители, представление в виде произведения

factorization разложение, разложение на множители (См. **decomposition**)

**conditional** ~ разложение на условное распределение и маргинальное распределение ???

failure неудача

**predictive** ~ неадекватность предсказаний {test}

falsification фальсификация, опровержение

falsify фальсифицировать, опровергать

family семейство

**~ of distributions** семейство распределений

**exponential** ~ экспоненциальное семейство распределений

feasible допустимый, возможный, выполнимый

feedback обратная связь

feedforward упреждение, предварение

fiducial фидуциальный {probability}

finite ограниченный, конечный {lag, sample}

**filter** фильтр || фильтровать

**Kalman** ~ фильтр Калмана (Кальмана)

**linear** ~ линейный фильтр

**seasonal** ~ сезонный фильтр

**filtering** фильтрация

**finite-lag** с конечным лагом

**first-order** первого порядка

**fit** подбор, соответствие, подобранная функция || подбирать, подгонять, соответствовать

**good** ~ точный подбор (предсказания модели хорошо соответствуют данным)

**poor** ~ плохой подбор (предсказания модели плохо соответствуют данным)

**fitted** подобранный, расчетный {value}

**fitting** подбор (как процесс), подгонка {criterion}

**fixed** постоянный, неизменный, фиксированный ( **deterministic**) {effects}

**~ in repeated samples** неизменный в повторных выборках

**forecast** прогноз, предсказание {adequacy of ~ , error}

**back** ~ обратный прогноз

**conditional** ~ условный прогноз

**dynamic** ~ динамический прогноз

**multi-step** ~ многошаговый прогноз

**one-step** ~ одношаговый прогноз

**static** ~ статический прогноз

**forecasting** прогнозирование {horizon, power}

**form** вид, форма

**functional** ~ функциональная форма {misspecification}

**quadratic** ~ квадратичная форма

**reduced** ~ приведенная форма

**restricted** ~ ограниченная форма

**restricted reduced** ~ ограниченная приведенная форма

**structural** ~ структурная форма

**unrestricted reduced** ~ неограниченная приведенная форма??

forward вперед || направленный вперед {selection}

fractile фрактиль, квантиль

fraction дробь, доля

fractional дробный

frequency частота (событий), частота (колебаний), периодичность || частотный  
{distribution, domain, function, table, window}

**data** ~ периодичность данных

**harmonic** ~ гармоническая частота

frontier граница

**stochastic** ~ стохастическая граница

function функция

**autocorrelation** ~ автокорреляционная функция

**beta** ~ бета-функция

**characteristic** ~ характеристическая функция

**concentrated likelihood** ~ концентрированная функция правдоподобия

**covariance generating** ~ производящая функция ковариации

**cumulative distribution** ~ [кумулятивная, интегральная] функция распределения

**demand** ~ функция спроса

**density** ~ функция плотности распределения

**decision** ~ решающая функция

**discriminant** ~ дискриминантная функция

**distribution** ~ функция распределения

**frequency** ~  **density function**

**frequency-generating** ~ производящая функция частот

**hazard** ~ функция риска???

**kernel** ~ ядерная функция???

**inverse distribution** ~ обратная функция распределения

**likelihood** ~ функция правдоподобия

**logistic** ~ логистическая функция, логиста???

**loss** ~ функция потерь

**moment-generating** ~ производящая функция моментов

**partial autocorrelation** ~ частная автокорреляционная функция

**penalty** ~ штрафная функция

**power** ~ функция мощности

**production** ~ производственная функция

**regret** ~ функция???

**scedastic** ~ скедастическая функция, функция (условной) дисперсии ошибки

**spectral density** ~ функция спектральной плотности

**spectral** ~ спектральная функция

**spline** ~ сплайн-функция

**transformation** ~ ???функция

**utility** ~ функция полезности

functional функциональный {form, relationship}

## G

gain выигрыш, увеличение

**efficiency** ~ выигрыш в эффективности

Gaussian гауссовский ( **normal**) {distribution, process}

general-to-specific от общего к частному

generation генерация, получение

generator

**random numbers** ~ датчик случайных чисел

global глобальный

goodness

~ **of fit** точность подбора, соответствие предсказаний модели данным, согласие

goodness-of-fit (☐ **goodness of fit**)

grid сетка (на графике), решетка

group группа

grouping группировка, группирование

groupwise по группам ???

guess догадка, предположение

## H

Hessian гессиан, матрица Гессе

harmonic гармонический || гармоника {component, frequency, regression}

hazard риск, шанс {function, proportional ~ model, rate}

heteroscedasticity гетероскедастичность {consistent}

**autoregressive conditional** ~ авторегрессионная условная гетероскедастичность

**conditional** ~ условная гетероскедастичность

**multiplicative** ~ мультипликативная гетероскедастичность

heteroskedasticity ☐ **heteroscedasticity**

high-frequency высокая частота || высокочастотный

high-order высшего порядка, старшего порядка

histogram гистограмма



homogeneous однородный

homogeneity однородность

homoscedasticity гомоскедастичность

homoskedasticity  ~~homoscedasticity~~

horizon горизонт

**forecasting** ~ горизонт прогнозирования

household домашнее хозяйство

hull оболочка

**convex** ~ выпуклая оболочка

hypothesis гипотеза  **to accept a** ~ принять гипотезу, **to reject a** ~ отвергнуть, отклонить гипотезу, **to test a** ~ проверить гипотезу {testing}

**alternative** ~ альтернативная гипотеза

**composite** ~ сложная гипотеза

**false** ~ неверная гипотеза, ложная гипотеза

**general linear** ~ общая линейная гипотеза

**implicit** ~ неявная гипотеза, подразумеваемая гипотеза

**interval** ~ интервальная гипотеза ???

**linear** ~ линейная гипотеза

**maintained** ~ утвержденная гипотеза??? ( **alternative** ~ )

**nested** ~ вложенная гипотеза

**non-nested** ~ невложенная гипотеза

**non-parametric** ~ непараметрическая гипотеза

**null** ~ нулевая гипотеза

**parametric** ~ параметрическая гипотеза

**point** ~ точечная гипотеза ????, простая гипотеза

**simple** ~ простая гипотеза

**true** ~ верная гипотеза, истинная гипотеза

**two-sided** ~ двусторонняя гипотеза

## I

**identifiability** идентифицируемость

**asymptotic** ~ асимптотическая идентифицируемость

**identifiable** идентифицируемый

**identification** идентификация {problem}

**model** ~ идентификация модели

**identified** идентифицированный

**exactly** ~ точно идентифицированный

**poorly** ~ плохо идентифицированный

**identity** тождество {matrix}

**ill-conditioned** плохо обусловленный

**impact** импульс, толчок, воздействие, влияние {matrix}

**implication** смысл, значение

**implicit** неявный, подразумеваемый {hypothesis}

**imply** подразумевать, значить, заключать в себе

**inaccuracy** неточность, ошибка

**inadequacy** неадекватность, несоответствие

**model** ~ неадекватность модели

**induced** индуцированный, порожденный, вызванный

**inconsistent** несостоятельный {estimator}

**increase** увеличение, прирост || возрасть, увеличивать(ся), расти

**increment** приращение, прирост

**independence** независимость


**~ of irrelevant alternatives** независимость от посторонних альтернатив

**asymptotic** ~ асимптотическая независимость

**conditional** ~ условная независимость

**linear** ~ линейная независимость

**stochastic** ~ ??? статистическая независимость

**independent** независимый  **of ...** не зависящий от..., независимый от... {events, trials, variable}

**asymptotically** ~ асимптотически независимый

**linearly** ~ линейно-независимые

**mutually** ~ взаимно независимые

**serially** ~ сериально независимый

**index** индекс

**indicator** индикатор, показатель {variable}

**inefficiency** неэффективность

**inefficient** неэффективный

**inelastic** неэластичный, негибкий

**inexact** неточный

**inequality** неравенство {restriction}

**Bonferroni** ~ неравенство Бонферрони

**Chebyshev's** ~ неравенство Чебышёва

**Cramer-Rao** ~ неравенство Крамера-Рао

**Jensen** ~ неравенство Йенсена

**inference** вывод (как результат и как процесс), заключение

**Bayesian** ~ байесовский вывод

**statistical** ~ статистические выводы, статистический вывод

**infinite** бесконечный, бесконечно большой {sample}

influence влияние, воздействие

influential влиятельный {observation}

information информация {(Akaike, Schwartz) criterion, matrix, set}

**a priori** ~ априорная информация

**extraneous** ~ внешняя информация

**prior** ~ априорная, предварительная информация

**sample** ~ выборочная информация

initial начальный, первоначальный {value}

innovation инновация (□) **disturbance, error**

inquiry исследование, обследование

in-sample в пределах выборки {performance}

insignificant незначимый (□) **insignificant at ...% level** незначимый при уровне ...%

instability нестабильность, неустойчивость

instantaneous мгновенный, немедленный {adjustment, causality, covariance}

instrument инструмент (□) **instrumental variable**

instrumental инструментальный {variable, variables}

integral интеграл, целое число || интегральный, целый

**probability** ~ интеграл вероятностей

integrated интегрированный (□) **integrated of order n** интегрированный  $n$ -го порядка {data, process, time series}

integratedness интегрированность

integration интеграция, интегрирование

interaction взаимодействие

intercept параметр отсечения; отрезок, отсекаемый на координатной оси; константа, свободный член (*в уравнении регрессии*)

interdependence взаимная зависимость

internal внутренний

interpolation интерполяция, интерполирование

interval интервал, отрезок, промежуток (См. тж. **region**) {estimation, hypothesis}

**confidence** ~ доверительный интервал

**non-central confidence** ~ нецентральный доверительный интервал

**prediction** ~ интервал предсказаний

**probability** ~ интервал вероятности

**tolerance** ~ допустимый интервал, толерантный интервал

intrinsic внутренний, присущий

intrinsically внутренне {linear, non-linear}

invariance инвариантность

~ **under linear transformations** инвариантность по отношению к линейным преобразованиям

**parameter** ~ инвариантность параметров

invariant инвариантный {test} || инвариант

inverse обратная величина {~ of matrix, distribution, distribution function}

**generalized** ~ обобщенная обратная матрица

invertible обратимый {matrix, process}

irregularity неправильность, нерегулярность

## J

J-test J-критерий

jack-knife относящийся к методу складного ножа {method, statistic}

jack-knife [method] метод складного ножа

(см. imit)

Jacobian якобиан, матрица Якоби {matrix}

joint совместный {density, distribution, confidence region}

## К

kernel ядро {estimation, function, smoothing}

kurtic куртический, относящийся к эксцессу / куртозису

kurtosis четвертый центральный момент, куртозис

**excess** ~ эксцесс

## L

lack недостаток, отсутствие || испытывать недостаток

~ **of fit** плохой подбор (предсказания модели не соответствуют данным, **poor** ~ ), неадекватность

lag лаг, запаздывание, задержка {length, operator, polynomial, truncation, weights, window}

**adjustment** ~ лаг приспособления

**Almon** ~ лаг Олмон ( **polynomial distributed** ~ )

**autoregressive distributed** ~ авторегрессионный распределенный лаг {model}

**distributed** ~ распределенный лаг {model}

**exponential** ~ экспоненциальный лаг

**expectation-formation** ~ лаг в формировании ожиданий

**expectations** ~ лаг ожиданий

**finite** ~ конечный лаг

**geometric** ~ геометрический лаг

**linear** ~ линейный лаг

**mean** ~ средний лаг

**polynomial** ~ полиномиальный лаг

**polynomial distributed** ~ полиномиальный распределенный лаг

**rational** ~ рациональный лаг

**time ~  $\square$ lag**

**lagged** запаздывающий, с лагом (о переменной) {effect, relationship, variable}

**lagging** запаздывание, отставание || запаздывающий

**Lagrangian** лагранжиан, функция Лагранжа

**large-sample** относящийся к большой выборке

**latent** скрытый, латентный {root, variable}

**law** {convergence in ~ }

**~ of large numbers** закон больших чисел

**empirical** ~ эмпирический закон

**lead** упреждение, опережение

**leading** упреждающий, опережающий {term, variable}

**least-square (s)** наименьших квадратов, относящийся к методу наименьших квадратов

**least squares [method]** метод наименьших квадратов (См. тж. **regression**)

**autoregressive** ~ авторегрессионный наименьших квадратов

**feasible generalized** ~ ??? обобщенный метод наименьших квадратов

**generalized** ~ обобщенный метод наименьших квадратов

**indirect** ~ косвенный метод наименьших квадратов

**non-linear** ~ нелинейный метод наименьших квадратов

**ordinary** ~ обычный метод наименьших квадратов

**recursive** ~ рекуррентный метод наименьших квадратов

**restricted** ~ метод наименьших квадратов с ограничениями

**length**

**lag** ~ длина лага {selection}

**lag truncation** ~ усечения лага???

**step** ~ длина шага

**leptokurtic** имеющий эксцесс, превышающий эксцесс нормального распределения, имеющий положительный эксцесс, лептокуртический???

**leptokurtosis** эксцесс, превышающий эксцесс нормального распределения, положительный эксцесс

**level** уровень

**accuracy** ~ уровень точности

**confidence** ~ уровень доверия

**conventional significance** ~ общепринятый, традиционный уровень значимости (обычно 5%)

**probability** ~ уровень вероятности

**risk** ~ уровень риска (☐ **significance level**)

**significance** ~ уровень значимости

**leverage** влиятельность, показатель влиятельности (наблюдений) {measure, point}

**likelihood** правдоподобие {equations, ratio, (concentrated) ~ function}

**concentrated** ~ [function] концентрированная функция правдоподобия

**maximum** ~ максимальное правдоподобие, метод максимального правдоподобия {exact} ~ estimate, estimation, method}

**limit** предел, граница (См. тж. **interval**) || ограничивать {central ~ theorem}

**confidence** ~ доверительная граница, доверительный предел

**lower** ~ нижняя граница

**probability** ~ вероятностный предел

**stochastic** ~ случайный предел

**tolerance** ~s допустимые пределы, толерантные пределы

**upper** ~ верхняя граница

**limited** ограниченный {dependent variable}

**limiting** предельный (☐ **asymptotic**), ограничивающий {distribution, variance}

**line** линия, прямая {search}

**regression** ~ линия регрессии



**trend** ~ линия тренда, тренд

**linear** линейный {dependence, estimation, estimator, filter, (general) ~ hypothesis, independence, lag, (general) ~ model, restriction, smoothing, transformation, trend}

**intrinsically** ~ внутренне линейный

**linearity** линейность

**linearization** линеаризация

**linearize** линеаризовать???

**loading**

**factor** ~ факторная нагрузка

**local** локальный {alternative}

**locally** локально {equivalent}

**log-**  **logarithmic**

**logarithmic** логарифмический {transformation}

**logit** логит

**multinomial** ~ мультиномиальный логит

**ordered** ~ упорядоченный логит

**logistic** логистический {curve, distribution, function, regression}

**loglikelihood [function]** логарифмическая функция правдоподобия

**loglinear** логлинейный, линейный в логарифмах {model}

**lognormal** логнормальный {distribution}

**log-transform** логарифм переменной, логарифмическое преобразование

**longitudinal** продольный???

**long-run** долгосрочный {effect, multiplier}

**loss** потеря, потери {function}

**~ of efficiency** потеря эффективности, утрата эффективности

**~ of information** потеря информации

**minimum expected** ~ минимальные ожидаемые потери {estimator}

low-frequency низкочастотный

low-order низкого порядка, младшего порядка

## M

macroeconometrics макроэконометрика, макроэконометрия

magnitude величина, размеры

marginal маргинальный (в статистике) {density, distribution}, предельный (в экономической теории)

marginalize ???

marginalization ???

martingale мартингал (~ difference sequence)

matrix матрица {algebra, differentiation, multiplication, partition, polynomial, rank of ~ }

**asymptotic covariance** ~ асимптотическая ковариационная матрица

**correlation** ~ корреляционная матрица

**covariance** ~ матрица ковариаций, ковариационная матрица

**block-diagonal** ~ блочно-диагональная матрица

**diagonal** ~ диагональная матрица

**dispersion** ~ дисперсионная матрица ( $\square$  covariance ~ )

**distance** ~ матрица расстояний

**hat** ~ матрица проекции на пространство регрессоров???

**Hessian** ~ матрица Гессе

**idempotent** ~ идемпотентная матрица

**identity** ~ единичная матрица

**impact** ~ матрица воздействия

- information** ~ информационная матрица {test}
- inverse of** ~ обратная матрица
- invertible** ~ обратимая матрица
- Jacobian** ~ матрица Якоби
- orthogonal** ~ ортогональная матрица
- orthonormal** ~ ортонормированная матрица
- negative-definite** ~ отрицательно определенная матрица
- Newey-West covariance** ~ ковариационная матрица (оценка ковариационной матрицы) Ньюи-Уэста???
- non-singular** ~ невырожденная матрица
- partitioned** ~ блочная матрица
- permutation** ~ перестановочная матрица, матрица перестановок
- positive-definite** ~ положительно определенная матрица
- projection** ~ матрица проекции
- pseudoinverse** ~ псевдообратная матрица
- singular** ~ особенная, вырожденная матрица
- symmetric(al)** ~ симметричная матрица, симметрическая матрица
- transition probability** ~ матрица переходных вероятностей
- transpose of** ~ транспонированная матрица
- triangular** ~ треугольная матрица
- variance-covariance** ~  $\square$  **covariance** ~
- variance** ~  $\square$  **covariance** ~
- White covariance** ~ ковариационная матрица (оценка ковариационной матрицы) Уайта???
- mean** среднее, среднее значение, [математическое] ожидание (См. **expectation**) {lag, square, value, variance about ~ }
- population** ~ генеральное среднее ( $\square$  **expectation**)
- sample** ~ выборочное среднее

**unconditional ~ □ unconditional expectation**

**mean-square** среднеквадратический {error}

**measurability** измеримость

**measure** мера {unit of ~ }

**~ of fit** показатель точности подбора

**leverage ~** показатель влиятельности (наблюдений)

**rank correlation ~** мера ранговой корреляции

**measurement** измерение {error}

**mechanism** механизм

**causal ~** причинный механизм

**error correction ~** корректирующий механизм

**median** медиана {value}

**mesokurtic** имеющий нормальный / нулевой эксцесс, мезокуртический

**mesokurtosis** нормальный эксцесс???, нулевой эксцесс

**method** метод, способ, прием (См. тж. **technique**)

**~ of least squares** метод наименьших квадратов

**~ of maximum likelihood** метод максимального правдоподобия

**~ of moments** метод моментов

**~ of scoring** метод???

**Bayesian ~s** байесовские методы

**Cochran-Orcutt ~** метод Кочрена-Оркатта

**distribution-free ~** свободный от распределения метод

**Engle-Granger ~** метод Энгла-Грейнджера

**estimation ~** метод оценивания

**Gauss-Newton ~** метод Гаусса-Ньютона

**generalized ~ of moments** обобщенный метод моментов

**generalized instrumental variables** ~ обобщенный метод инструментальных переменных

**gradient** ~ градиентный метод

**instrumental variables** ~ метод инструментальных переменных

**jack-knife** ~ метод складного ножа

**Johansen** ~ метод Йохансена

**least distance** ~ метод наименьших расстояний

**least squares** ~ метод наименьших квадратов

**Marquardt** ~ метод Марквардта

**maximum likelihood** ~ метод максимального правдоподобия

**Newton** ~ метод Ньютона

**Newton-Rafson??** ~ метод Ньютона-Рафсона (☐|**Newton** ~ )

**outer product of gradient** ~ метод внешнего произведения градиента

**principal components** ~ метод главных компонент

microeconometrics микроэконометрика, микроэконометрия

minimand минимизируемое, то, что минимизируется

mining

**data** ~ “копание в данных”

misspecification неправильная спецификация, ошибка спецификации {test}

**functional form** ~ неправильная спецификация функциональной формы

mixture смесь ☐+ **of distributions** смесь распределений

mixing смешивание,??? {distribution, sequence}

mode мода

model модель {adequacy, building, choice, identification, inadequacy, performance, selection, specification}

**autoregression (autoregressive)** ~ авторегрессионная модель

**autoregressive (autoregression) moving average** ~ смешанная модель авторегрессии и скользящего среднего

**autoregressive distributed lag** ~ авторегрессионная модель с распределенным лагом

**binary choice** ~ модель бинарного выбора

**Box-Jenkins** ~ модель Бокса-Дженкинса

**Brookings** ~s Брукингские модели

**cobweb** ~ паутинообразная модель

**congruent** ~ подходящая модель

**distribution-free** ~ свободная от распределения модель

**discrete choice** ~ модель дискретного выбора

**DHSY** ~ модель DHSY (Davidson, Hendry, Srba, Yeo (1978) “Econometric Modelling of the Aggregate Time-series Relationship between Consumers’ Expenditure and Income in the United Kingdom”)

**duration** ~ модель продолжительности???

**dynamic** ~ динамическая модель

**error-component** ~ модель со случайными компонентами???

**error correction** ~ модель исправления ошибок

**errors-in-variables** ~ модель с ошибками в переменных

**fixed-effects** ~ модель с фиксированными эффектами

**general linear** ~ общая линейная модель

**Klein** ~ модель Клейна

**limited dependent variable** ~ модель с ограниченной зависимой переменной

**linear** ~ линейная модель

**loglinear** ~ логлинейная (линейная в логарифмах) модель

**multiplicative** ~ мультипликативная модель

**moving average** ~ модель скользящего среднего

**nested** ~ вложенная модель

**non-nested** ~ невложенная модель

**non-parametric** ~ непараметрическая модель

**Oxford economic forecasting** ~ ???

**parametric** ~ параметрическая модель

**parsimonious** ~ экономная (с т. зр. количества параметров), простая модель

**partial adjustment** ~ модель частичного приспособления

**proportional hazard** ~ пропорционального??? модель

**quadratic** ~ квадратичная модель

**qualitative dependent variable** ~ модель с качественной зависимой переменной

**random coefficients** ~ модель со случайными коэффициентами

**random-effects** ~ модель со случайными эффектами

**rival ~s** “конкурирующие” модели

**St Louis** ~ сент-луисская модель

**stochastic** ~ стохастическая модель

**structural** ~ структурная модель

**survival** ~ ???

**translog** ~ транслоговая модель

**true** ~ истинная модель

**variable parameter** ~ модель с изменяющимися параметрами

**Wharton** ~ уортонская??? модель

model (l) ing моделирование, построение модели

**general-to-specific** ~ моделирование от общего к частному

moment момент **n-th** ~  $n$ -й момент {condition, equation, (generalized) method of ~s }

**central** ~ центральный момент

**conditional** ~ условный момент {test}

**mixed** ~ смешанный момент

**non-central** ~ нецентральный момент

**population** ~ момент генеральной совокупности

**product** ~ смешанный момент

**Monte-Carlo** относящийся к методу Монте-Карло {experiment, simulation, technique}

**motion**

**Brownian** ~ броуновское движение

**multicollinearity** мультиколлинеарность

**multinomial** мультиномиальный, множественный, полиномиальный, многочленный {distribution, logit, probit} || многочлен, полином ???

**multiple** множественный {choice, coefficient, correlation, regression}

**multiplication** умножение

**matrix** ~ матричное умножение

**pointwise** ~ покоординатное умножение

**multiplier** множитель, мультипликатор (в кейнсианстве)

**dynamic** ~ динамический мультипликатор

**Lagrange** ~ множитель Лагранжа {statistic, test}

**long-run** ~ долгосрочный мультипликатор

**short-run** ~ краткосрочный мультипликатор

**multivariate** многомерный {analysis, density, (normal) distribution, regression}

## N

**negligible** незначительный, пренебрежимо малый

**neighborhood** окрестность

**nest** вкладывать

**nested** вложенный (о гипотезе или модели)

**nesting** вложение (одной гипотезы/модели в другую)



**artificial** ~ искусственное вложение

**noise** шум, помехи ( **disturbance**)

**white** ~ белый шум {error, process}

**non-causality** отсутствие причинной связи

**non-central** нецентральный (о распределении) {distribution, interval, moment}

**non-centrality** нецентральность {parameter}

**non-degenerate** невырожденный

**non-linear** нелинейный {estimation, least squares, regression, restriction}

**~ in variables** нелинейный в переменных

**intrinsically** ~ внутренне нелинейный

**non-linearity** нелинейность {test}

**non-negative** неотрицательный

**non-negligible** значительный, заметный, существенный

**non-nested** невложенный (о гипотезе) {hypothesis, model, test}

**non-normality** ненормальность, несоответствие нормальному распределению

**non-parametric** непараметрический {estimate, estimation, hypothesis, model, regression, statistic, test}

**non-random** неслучайный

**non-stationary** нестационарный

**non-stochastic** нестохастический, неслучайный

**norm** норма || нормировать

**normal** нормальный, относящийся к нормальному распределению

**asymptotically normal** ~ асимптотически нормальный {(binomial, multivariate) distribution, equation, plot}

**normality** нормальность, соответствие нормальному распределению {asymptotically, normality, test}

**asymptotic** ~ асимптотическая нормальность

normalization нормирование, нормировка, нормализация

null нулевой, относящийся к нулевой гипотезе {event, hypothesis, vector}

null [hypothesis] нулевая гипотеза  **under the ~** в условиях нулевой гипотезы, когда верна нулевая гипотеза

number число {law of large ~s }

**condition ~** число обусловленности

**random ~** случайное число, случайная величина {~s generator}

numerical численный {derivative}

numerically численно

## O

observation наблюдение {error, unit}

**artificial ~** искусственное наблюдение

**influential ~** влиятельное наблюдение

**outlying ~** резко отклоняющееся наблюдение, выброс (См. **outlier**)

observational {equivalence}

observed наблюдаемый {value}

odds шансы {ratio}

**posterior ~** апостериорные ???шансы

**prior ~** априорные ???шансы

omitted пропущенный {variable}

one-sided односторонний {test}

one-step одношаговый {efficient, forecast}

one-tail  **one-sided** {test}

operator оператор

**difference (differencing) ~** оператор разности, разностный оператор

**expectation** ~ оператор математического ожидания

**lag** ~ лаговый оператор

**variance** ~ оператор дисперсии

optimal оптимальный, наилучший

optimization оптимизация

**constrained** ~ условная оптимизация

**order** порядок, кратность || упорядочивать || порядковый {autoregression of n-th ~ , condition, integrated of ~ n, statistic}

**~ of magnitude** порядок величины. чисел??

**cointegration** ~ порядок коинтеграции ( $\square$  **cointegration rank**)

ordered упорядоченный {data, logit, probit, sample}

ordering упорядочение, порядок

ordinal порядковый

orthogonal ортогональный {complement, component, decomposition, design, matrix, parameters, polynomials, projection, regression, resolution, transformation}

orthogonality ортогональность {condition}

orthogonalization ортогонализация

oscillation колебание, осцилляция

outcome исход, результат

outlier выброс, резко выделяющееся значение

out-of-sample за пределами выборки {performance}

over-differencing ???

over-dispersion ??? избыточное рассеяние

over-estimate переоценивать, давать завышенную оценку || завышенная оценка

over-fitting ???

over-identification сверхидентификация, переопределенность???

over-identified сверхидентифицированный

overlap перекрывать

overlapping перекрывающийся

over-parametrized ???

over-perform превосходить по рабочим характеристикам

over-predict давать завышенное предсказание

over-reject отвергать нулевую гипотезу слишком часто (о критерии)

over-smoothed пересглаженный

## P

P-value  **probability value**

pairwise попарно || попарный

paradigm парадигма

**Bayesian** ~ байесовская парадигма

parameter параметр (См. тж. **coefficient**) {constancy, invariance, restriction on ~s, space, stability}

**non-centrality** ~ параметр нецентральности

**nuisance** ~ мешающий параметр

**orthogonal ~s** ортогональные параметры

**population** ~ ??? теоретический параметр, параметр генеральной совокупности

**redundant** ~ избыточный параметр

**restricted** ~ ограниченный параметр, параметр с ограничениями

**sample** ~ [выборочная] оценка параметра

**scale** ~ параметр масштаба

**time-dependent** ~ зависящий от времени параметр

**time-varying** ~ меняющийся во времени параметр

**true** ~ истинный параметр

**unknown** ~ неизвестный параметр

**variable** ~ изменяющийся параметр ( **time-varying** ~ ) {model}

parameter-free свободный от параметров {test}

parametric параметрический {estimation, hypothesis, model}

parametrization параметризация

parent population относящийся к генеральной совокупности, теоретический (См. тж.)

parsimonious экономный, простой (о модели) {encompassing, model}

parsimony экономия, экономность, простота (букв. бережливость, скупость) {principle}

partial частный, частичный, неполный {adjustment, autocorrelation, correlogram, autocorrelation function}

partial out ??? нет такого глагола в словарях

partition разбиение (См. тж. **decomposition**) || разбивать, разделять

**matrix** ~ блочное разбиение матрицы

**sum-of-squares** ~ разложение суммы квадратов

pattern схема, структура (букв. узор), образец {recognition}

**seasonal** ~ структура сезонности, характер сезонности

penalty штраф {function}

percentage процент, процентное отношение, доля {point}

percentile процентиль

performance поведение, характеристика, качество работы

**model** ~ качество модели (насколько хорошо “работает” модель)

**in-sample** ~ поведение в пределах выборки

**out-of-sample** ~ поведение за пределами выборки (точность предсказаний)

period период, временной интервал, срок

**base** ~ базисный период

**estimation** ~ период оценивания

**sample** ~ период выборки??? выборочный период

**periodic** периодический, циклический

**periodogram** периодограмма, график спектральной функции

**permutation** перестановка {matrix}

**persistence** постоянство, долгое сохранение эффекта, инерция

**perturbation** возмущение, пертурбация

**pilot** пробный, предварительный, экспериментальный

**pivotal** центральный, осевой, опорный???? {statistic}

**plan** план

**platykurtic** с эксцессом меньше нормального, имеющий отрицательный эксцесс, платикуртический???

**platykurtosis** эксцесс меньше нормального, отрицательный эксцесс ???

**plausible** правдоподобный, вероятный

**plot** график

**normal** ~ график нормального распределения

**point** точка {estimate, estimation, hypothesis}

**data** ~ (отдельное) наблюдение

**leverage** ~ влиятельная точка

**percentage** ~ процентная точка

**turning** ~ поворотная точка

**point-optimal** точно-оптимальный

**polynomial** многочлен, полином || полиномиальный {(distributed) lag, regression, trend}

**characteristic** ~ характеристический многочлен

**lag** ~ лаговый многочлен

**matrix** ~ матричный многочлен

**orthogonal ~s** ортогональные многочлены

**population** генеральная совокупность || относящийся к генеральной совокупности, генеральный, теоретический {mean, moment, parameter}

**posterior** апостериорный {density, distribution, odds, probability}

**post-multiplication** умножение справа

**power** мощность (критерия), сила, степень {function, series, spectrum}

**asymptotic** ~ асимптотическая мощность

**explanatory** ~ объяснительная сила

**forecasting** ~ предсказательная сила, точность предсказаний

**test** ~ мощность критерия

**powerful** мощный

**most** ~ наиболее мощный

**uniformly most** ~ равномерно наиболее мощный {test}

**precision** точность

**prior** ~ ???

**sample** ~ ???

**pre-determined** предопределенный

**prediction** предсказание, прогноз {Amemiya's ~ criterion, error, interval}

**biased** ~ смещенный прогноз

**predictive** предсказывающий, прогнозный {error, failure}

**predictor** предиктор, предсказывающая переменная ( $\square$  regressor), предсказывающая функция

**pre-multiplication** умножение слева

**pre-sample** довыборочный

**pre-test** ???

**pre-testing** ???

pre-whitening предварительное отбеливание

principle

**encompassing** ~ принцип охвата

**parsimony** ~ принцип экономии (в описании действительности), принцип простоты

prior предварительный, предшествующий, априорный || предварительная, априорная информация, априорные предположения {believes, density, distribution, information, odds, precision, probability}

**smoothness** ~s априорная информация о гладкости функции???

probability вероятность {convergence in ~ , density, integral, interval, level, limit, transition ~ matrix, space, value}

**conditional** ~ условная вероятность

**fiducial** ~ фидуциальная вероятность

**posterior** ~ апостериорная вероятность

**prior** ~ априорная вероятность

**subjective** ~ субъективная вероятность

**survival** ~ вероятность дожития

**transition** ~ вероятность перехода

probit пробит

**multinomial** ~ мультиномиальный множественный ???пробит

**ordered** ~ упорядоченный пробит

problem проблема, задача, вопрос

**identification** ~ проблема идентификации

procedure процедура, метод действия (См. т.ж. **method, technique**)

**Hildreth-Lu** ~ метод Хилдрета-Лу

process процесс

**adjustment** ~ процесс приспособления

**autoregressive** ~ авторегрессионный процесс



**cointegrated** ~ коинтегрированный процесс

**correlated** ~ коррелированный процесс

**data generating** ~ порождающий данные процесс

**data generation** ~  **data generating** ~

**difference-stationary** ~ стационарный в первых разностях процесс

**ergodic** ~ эргодический процесс

**explosive** ~ “взрывной” процесс

**gaussian** ~ гауссовский процесс

**integrated** ~ интегрированный процесс

**invertible** ~ обратимый процесс

**moving-average** ~ процесс скользящего среднего

**Markoff(Markov)** ~ марковский процесс

**Poisson** ~ пуассоновский процесс

**random** ~ случайный процесс

**random walk** ~ процесс случайного блуждания

**stationary** ~ стационарный процесс

**stochastic** ~ стохастический процесс, случайный процесс

**trend-stationary** ~ стационарный относительно тренда процесс

**white noise** ~ белый шум??

**Wiener** ~ винеровский процесс

**Yule** ~ процесс Юла

processing обработка

**data** ~ обработка данных

product произведение {moment}

**inner** ~ внутреннее произведение (матриц), скалярное произведение

**direct** ~ прямое произведение???

**Kronecker** ~ произведение Кронекера

**outer** ~ внешнее произведение (матриц)

**outer ~ of gradient** внешнее произведение градиента {method, regression, test}

**scalar** ~ скалярное произведение

projection проекция {matrix}

**orthogonal** ~ ортогональная проекция

property свойство

**asymptotic ~s** асимптотические свойства

**finite-sample ~s** свойства в конечной выборке

proportion доля, пропорция, соотношение {data ~s }

proxy [variable] заместитель, эрзац-переменная (не очень качественный заместитель переменной, которая должна стоять в уравнении)

pseudo-inverse псевдообратный

pseudo-random псевдослучайный

## Q

Q-statistic Q-статистика (См. **Box-Pierce test**)

qualitative качественный {dependent variable}

quantile квантиль

quantitative количественный

quarterly кварталный

quartile квартиль

quasi- квази-, псевдо-

quasi-random псевдослучайный

quotient частное, коэффициент, отношение

## R

**randomization** рандомизация {test}

**randomize** рандомизировать

**randomized** рандомизированный, случайный

**range** диапазон, размах, интервал

**interdecile** ~ интердецильный размах

**interquartile** ~ интерквартильный размах

**sample (sampling)** ~ размах выборки

**rank** ранг {condition, correlation, reduced ~ restrictions, test}

**~ of a matrix** ранг матрицы

**cointegration** ~ ранг коинтеграции

**full** ~ полный ранг

**ranking** упорядочивание, ранжирование

**rate** норма, ставка, коэффициент, доля

**~ of convergence** скорость сходимости

**growth** ~ темп роста, темп прироста

**hazard** ~ ???

**survival** ~ коэффициент дожития, коэффициент выживаемости

**ratio** отношение, пропорция, коэффициент {statistic, test}

**likelihood** ~ отношение правдоподобия

**odds** ~ ???

**variance** ~ дисперсионное отношение

**reciprocal** обратная величина

**recognition** распознавание, различение

**pattern** ~ распознавание образов

**recursive** рекуррентный, рекурсивный {estimation, least squares, regression, residual, system}

**reduce** сокращать, уменьшать, превращать, сводить, преобразовывать

**reduced** приведенный, сокращенный {form}

**reduction** приведение, сведение, преобразование, сокращение, уменьшение

**data** ~ сокращение данных

**variance** ~ понижение дисперсии

**redundant** избыточный, излишний {parameter, variable}

**regime** режим {shift, switch}

**region** область (См. тж. **interval**)

**acceptance** ~ область принятия гипотезы

**confidence** ~ доверительная область

**critical** ~ критическая область

**joint confidence** ~ совместная доверительная область

**rejection** ~ область отклонения гипотезы ( $\square$  | **critical** ~ )

**stationarity** ~ область стационарности

**regressand** регрессанд, зависимая переменная в регрессии

**regression** регрессия {coefficient, curve, equation, estimate, line, significance, variance about ~ }  $\square$  of Y on X регрессия Y по/на X

**artificial** ~ искусственная регрессия

**auxiliary** ~ вспомогательная регрессия

**censored** ~ цензурированная регрессия

**double-length** ~ удвоенная регрессия

**dynamic** ~ динамическая регрессия

**Gauss-Newton** ~ регрессия Гаусса-Ньютона

**harmonic** ~ гармоническая регрессия

**logistic** ~ логистическая регрессия

**multivariate** ~ множественная регрессия????

**multiple** ~ множественная регрессия

**non-linear** ~ нелинейная регрессия

**non-parametric** ~ непараметрическая регрессия

**nonsense** ~ бессмысленная регрессия

**orthogonal** ~ ортогональная регрессия

**outer product of gradient** ~ регрессия внешнего произведения градиента

**Poisson** ~ пуассоновская регрессия, регрессия Пуассона

**polynomial** ~ полиномиальная регрессия

**quantile** ~ квантильная регрессия

**recursive** ~ рекуррентная регрессия

**ridge** ~ гребневая регрессия, ридж-регрессия

**semiparametric** ~ полупараметрическая регрессия

**simple** ~ простая регрессия

**spurious** ~ ложная регрессия

**static** ~ статическая регрессия

**stepwise** ~ ступенчатая регрессия

**switching** ~ переключающаяся регрессия

**truncated** ~ усеченная регрессия

regressive регрессионный {expectations}

regressor регрессор, независимая переменная в регрессии

reject отклонять, отбрасывать, отвергать {to ~ a hypothesis}

relation отношение, связь, зависимость (См. тж. **relationship**)

**negative** ~ отрицательная связь

**positive** ~ положительная связь

**strong** ~ сильная связь

relationship отношение, соотношение, зависимость, связь (См. тж. **relation**)

**cointegrating** ~ коинтегрирующее отношение

**functional** ~ функциональная связь

**lagged** ~ зависимость с лагом

**spurious** ~ ложная зависимость

relative относительный, сравнительный {asymptotic ~ efficiency, variance}

reliability достоверность, надежность

renormalization перенормировка

reparametrization репараметризация, замена параметров

replication повторение

representation представление

**Granger** ~ представление Грейнджера ???

residual остаток || остаточный {autocorrelation, correlogram, sum of squared ~s, sum of squares, variance}

**autocorrelated ~s** автокоррелированные остатки

**generalized ~s** обобщенные остатки

**recursive** ~ рекуррентный остаток, остаток из рекуррентной регрессии???  
рекурсивный остаток

**squared** ~ квадрат остатка

**standardized ~s** нормированные остатки

**studentized ~s** стьюдентизированные остатки

residual-based на основе остатков, основанный на остатках


resolution

**orthogonal** ~ ортогональное разложение

response отклик, реакция, ответ {surface, variable}

responsiveness чувствительность

restricted ограниченный?? {estimate, (reduced) form, least squares, parameter}

**restriction** ограничение, функция ограничения  **to impose a ~** наложить ограничение {set of ~s}

**~ on parameters** ограничение на параметры

**a priori ~** априорное ограничение

**cointegration ~s** коинтеграционные ограничения

**common factor ~** ограничение???

**cross-equation ~s** ???

**equality ~** ограничение в виде равенства

**identifying ~s** идентифицирующие ограничения

**inequality ~** ограничение в виде неравенства

**linear ~** линейное ограничение

**non-linear ~** нелинейное ограничение

**over-identifying ~s** сверхидентифицирующие ограничения???

**reduced rank ~s** ??

**stochastic ~s** стохастические ограничения

**zero ~** ограничение, состоящее в том, что параметр равен нулю

**revision** пересмотр, исправление

**data ~** пересмотр данных

**risk** риск {level}

**Bayes ~** байесовский риск

**robust** робастный, устойчивый к отклонениям от принятых предположений

**robustness** робастность, устойчивость к отклонениям от принятых предположений

**root** корень

**explosive ~** “взрывной” корень

**latent ~**  **eigen-value**

**square ~** квадратный корень {decomposition, transformation}

**stable** ~ стабильный корень

**unit** ~ единичный корень {test}

**root-mean-square** среднеквадратический

**rotation** вращение


**rule** правило

**~ of thumb** практическое, эмпирическое правило/прием

**Bayes decision** ~ байесовское решающее правило

**decision** ~ решающее правило

## S

**sample** выборка || выборочный {correlation, coefficient, data, distribution, to draw ~, error, estimate, fixed in repeated ~s, information, mean, parameter, period, precision, range, selection, size, space, unit, value, variance}  **with replacement** выборка с возвращением

**artificial** ~ искусственная выборка

**balanced** ~ уравновешенная выборка

**biased** ~ смещенная выборка, необъективная выборка

**censored** ~ цензурированная выборка

**finite** ~ конечная выборка {properties}

**infinite** ~ бесконечная выборка

**large** ~ большая выборка {valid in ~s}

**moderate** ~ выборка среднего размера

**ordered** ~ упорядоченная выборка

**random** ~ случайная выборка

**representative** ~ представительная выборка, репрезентативная выборка

**small** ~ малая выборка

**truncated** ~ усеченная выборка

**sampling** выбор, взятие выборок, выборка {range} || выборочный



~ **with replacement** выбор с возвращением

**correlated** ~ коррелированный выбор

**selective** ~ избирательный выбор

scalar скаляр {product}

scale масштаб, шкала, размер {factor, parameter}

scaling масштабирование, изменение масштаба

scatter [plot, diagram] диаграмма рассеяния

scedastic скедастический (относящийся к дисперсии) {function}

scheme схема, процесс (См. **process**)

**autoregressive** ~ авторегрессионная схема, авторегрессионный процесс

**Markoff (Markov)** ~ марковский процесс

**Yule** ~ процесс Юла

score ??? {test, vector}

**efficient** ~ ???  **score** {test}

scoring ??? {method of ~ }

screening отсеивание

search

**grid** ~ ???

**line** ~ одномерная оптимизация ????

**random** ~ случайный поиск, оптимизация методом Монте-Карло

seasonal сезонный {adjustment, dummy, effect, filter, pattern, variable, variations}

seasonal [variable] сезонная переменная

seasonality сезонность

second-order второго порядка

selection отбор, выбор {bias}

**bandwidth** ~ выбор ширины окна

**forward** ~ метод включения???

**lag length** ~ выбор длины лага

**model** ~ выбор, подбор модели

**sample** ~ отбор наблюдений

selectivity избирательность `{bias}`

semi-log  **semi-logarithmic**

semi-logarithmic полулогарифмический

semi-parametric полупараметрический

sensitivity чувствительность

sequence последовательность

**ergodic** ~ эргодическая последовательность

**martingale difference** ~ ???

**mixing** ~ последовательность???

**random** ~ случайная последовательность

sequential последовательный `{testing}`

serial сериальный, последовательный `{correlation, expansion}`

serially сериально, последовательно `{correlated, independent}`

series ряд (См. тж. **process**)

**ergodic time** ~ эргодический временной ряд

**Edgeworth** ~ ряд Эджворта

**integrated time** ~ интегрированный временной ряд

**power** ~ степенной ряд

**stationary** ~ стационарный ряд

**Taylor** ~ ряд Тейлора

**time** ~ временной ряд

**wandering** ~ блуждающий ряд

**set** множество, набор, система, серия

**~ of equations** система уравнений

**~ of restrictions** набор ограничений

**data** ~ набор данных

**information** ~ информационное множество

**shift** сдвиг, изменение, переключение

**regime** ~ изменение режима

**short-run** краткосрочный {effect, multiplier}

**sign** знак {test}

**correct** ~ верный знак, правильный знак

**wrong** ~ неверный знак

**significance** значимость, уровень значимости {(conventional) ~ level}

**regression** ~ значимость регрессии

**statistical** ~ статистическая значимость

**test** ~ значимость критерия, уровень значимости критерия

**significant** значимый  **significant at ...% level** значимый на уровне ...%

**simulated** ???симулированный, сгенерированный

**simulation** моделирование, имитация, имитационное моделирование, имитационный эксперимент

**Monte-Carlo** ~ метод Монте-Карло

**simultaneous** одновременный, совместный {equations, system}

**simultaneity** одновременность, совместность??? {bias}

**singular** вырожденный, сингулярный {matrix, equation system, value}

**size** размер, величина {correction, distortion}

**sample** ~ размер выборки

**test** ~ размер критерия

skedastic  **skedastic**

skew ассиметричный, скошенный

skewed  **skew**

skewness асимметрия, скошенность {coefficient}

slope угловой коэффициент, наклон (о линейной функции) {coefficient}

small-sample относящийся к малой выборке {distribution}

smooth гладкий || сглаживать {component, curve}

smoothing сглаживание {window}

**exponential** ~ экспоненциальное сглаживание

**kernel** ~ ядерное сглаживание

**linear** ~ линейное сглаживание

**spline** ~ сглаживание сплайном

smoothness гладкость {priors}

source источник, начало, первопричина

~ **of variation** источник вариации

space пространство

**cointegration** ~ коинтеграционное пространство

**error** ~ пространство ошибок

**estimation** ~ пространство оценок

**parameter** ~ пространство параметров

**probability** ~ вероятностное пространство

**sample** ~ выборочное пространство

span [линейная] оболочка || охватывать, натягивать (на вектора)

spatial пространственный {autocorrelation}

**specification** спецификация {error, test}

**dynamic** ~ динамическая спецификация

**model** ~ спецификация модели, описание модели

**system** ~ спецификация системы

**temporal** ~ временная спецификация (□dynamic ~)

**spectra** множ. ч. от **spectrum**

**spectral** спектральный {analysis, decomposition, density, function, window}

**spectrum** спектр, спектральная функция, спектральная плотность || спектральный

**band** ~ полосовой спектр (mathTerm add)

**power** ~ спектральная функция

**spline** сплайн {function}

**cubic** ~ кубический сплайн

**spread** разброс, вариация

**square** {root, (explained, residual, total) sum of ~s}

**least ~s [method]** метод наименьших квадратов (См. **least squares**, См. тж. **regression**)

**weighted least ~s [method]** взвешенный метод наименьших квадратов

**mean** ~ средний квадрат

**stability** стабильность, устойчивость {condition}

**parameter** ~ стабильность параметров

**structural** ~ стабильность структуры, структурная стабильность

**stabilization** стабилизация

**variance** ~ стабилизация (уравнивание) дисперсии

**standard** стандартный, среднеквадратический {deviation, (asymptotic, coefficient) ~ error}

**standardize** стандартизировать, нормировать, нормализовать

**standardized** стандартизованный, нормированный, нормализованный {residuals, value, vector}

**starting** начальный {value}

**state** состояние

**static** статический {expectations, forecast, regression, system} || статика

**statical** статический, неподвижный, стационарный

**stationarity** стационарность {condition, region}

**strict** ~ строгая стационарность?? в узком смысле

**weak** ~ слабая стационарность

**stationary** стационарный, установившийся {series, process, value, variable, variable}

**covariance** ~ стационарный ??? (☐ **weakly** ~ )

**difference** ~ стационарный в первых разностях, стационарный в приращениях {process}

**strictly** ~ строго стационарный?? стационарный в узком смысле

**strongly** ~ строго стационарный??

**trend** ~ стационарный относительно тренда {process}

**weakly** ~ слабо стационарный

**statistic** статистика (См. т.ж. **test**), статистический показатель

**descriptive** ~ описательная статистика

**Durbin-Watson** ~ статистика Дарбина-Уотсона

**goodness-of-fit** ~ статистика согласия

**jack-knife** ~ статистика “складного ножа”

**Lagrange multiplier** ~ статистика множителя Лагранжа

**likelihood ratio** ~ статистика отношения правдоподобия

**non-parametric** ~ непараметрическая статистика

**order** ~ порядковая статистика

**pivotal** ~ центральный, осевой, опорный???? статистика

**sufficient** ~ достаточная статистика

**summary ~s** сводка статистик

**test** ~ статистика критерия, критериальная статистика

**trace** ~ статистика следа

**statistical** статистический {inference, significance}

**statistically** статистически {valid}

**statistics** статистика (как наука), статистические методы, статистические данные

**steady-state** установившийся, стационарный

**stochastic** стохастический, случайный {approximation, convergence, expansion, frontier, independence, limit, model, process, restrictions, system, trend, variable}

**stratification** расслоение, стратификация

**structure** структура

**lag** ~ структура лага

**structural** структурный {change, form, model, stability}

**Student** стьюдентов, Стьюдента {distribution}

**Student-t** t-Стьюдента

**studentization** стьюдентизация

**studentize** стьюдентизировать

**studentized** стьюдентизированный {residuals}

**subsample** подвыборка, часть выборки

**sufficiency** достаточность

**sufficient** достаточный {statistic}

**sum** сумма

**~ of squares** сумма квадратов (decomposition)

**~ of squared residuals** ( $\square$ ) residual ~ of squares)

**cumulative ~ of squares** кумулятивная сумма квадратов {test}

**explained ~ of squares** объясненная сумма квадратов

**residual ~ of squares** сумма квадратов остатков, остаточная сумма квадратов

**total ~ of squares** общая сумма квадратов

super-consistent сверхсостоятельный

super-efficient сверхэффективный

super-exogenous сверхэкзогенный

surface поверхность

**response** ~ поверхность отклика

surprise неожиданность, неожиданное отклонение (□ **innovation**) || неожиданный

survey [выборочное] обследование, опрос

survival дожитие, выживание, продолжительность существования, доживаемость, выживаемость {data, model, probability, rate, time}

switch переключение, изменение

**regime** ~ изменение режима

switching переключающийся {regression}

system система, система уравнений {dynamics, estimator, specification}

**~ of demand equations** система уравнений спроса

**dynamic ~ [of equations]** динамическая система [уравнений]

**singular equation** ~ вырожденная система уравнений

**recursive** ~ рекурсивная система

**simultaneous** ~ система одновременных уравнений

**static** ~ статическая система

**stochastic** ~ стохастическая система

## T

t-distribution t-распределение, распределение Стьюдента

t-statistic t-статистика, статистика Стьюдента



table таблица

**contingency** ~ таблица сопряженности, таблица сопряженности признаков (ЭкТеор)

**frequency** ~ частотная таблица

tail хвост (распределения)

**heavy** ~ тяжелый хвост

**long** ~ вытянутый хвост, удлинённый хвост

**lower** ~ нижний хвост

**thick** ~ толстый хвост

**upper** ~ верхний хвост

technique метод, способ, техника (См. тж. **method**)

**Bayesian** ~ байесовский метод

**estimation** ~ метод оценивания

**gradient** ~ градиентный метод

**iterative** ~ итеративный метод

**Monte-Carlo** ~ метод Монте-Карло

temporal временной, временный {specification}

tentative пробный {assumption}

term член

**constant** ~ константа, свободный член (См. тж. **intercept**)

**error correction** ~ корректирующий член (в модели исправления ошибок) (См. тж. **error correction model**)

**leading** ~ главный член

**leading-order** ~ член высшего порядка??? (**leading** ~ )

**quadratic** ~ квадратичный член

test критерий, тест {power, significance, size, statistic} || проверять **to** ~ **a**  
**hypothesis** проверить гипотезу

**asymptotic** ~ асимптотический критерий

**augmented Dickey-Fuller** ~ дополненный критерий Дики-Фуллера

**autocorrelation** ~ критерий автокорреляции [остатков]

**Box-Pierce** ~ критерий Бокса-Пирса

**break-point** ~ критерий перелома в тенденции (См. т.ж. **Chow** ~ )

**C(a)** ~ ???

**chi-square** ~ критерий хи-квадрат

**Chow** ~ критерий Чоу

**cointegration** ~ коинтеграционный критерий, критерий коинтеграции

**common factor** ~ критерий общего множителя

**conditional moment** ~ критерий условного момента

**consistent** ~ состоятельный критерий

**cumulative sum** ~ критерий кумулятивной суммы, CUSUM

**cumulative sum of squares** ~ критерий кумулятивной суммы квадратов, CUSUMSQ

**diagnostic** ~ диагностический критерий

**Dickey-Fuller** ~ критерий Дики-Фуллера

**differencing** ~ критерий приращений

**Durbin's h** ~ h-критерий Дарбина

**Durbin-Watson** ~ критерий Дарбина-Уотсона

**efficient score** ~ ???  $\square$  **Lagrange multiplier** ~

**efficient** ~ эффективный критерий

**encompassing** ~ охватывающий критерий???

**exact** ~ точный критерий

**Glejser** ~ критерий Глейзера

**Godfrey** ~ критерий Годфрея

**Goldfeld-Quandt** ~ критерий Голдфельда-Квандта

**goodness-of-fit** ~ критерий согласия

**Hausman** ~ критерий Хаусмана

**homogeneity** ~ критерий однородности

**information matrix** ~ критерий информационной матрицы

**invariant** ~ инвариантный критерий

**Jarque-Bera** ~ ???

**Lagrange multiplier** ~ критерий множителя Лагранжа

**Ljung-Box** ~ критерий Льюнга-Бокса???

**likelihood ratio** ~ критерий отношения правдоподобия

**misspecification** ~ критерий ошибки спецификации

**most powerful** ~ наиболее мощный критерий

**non-linearity** ~ критерий нелинейности

**non-nested** ~ невложенный критерий

**non-parametric** ~ непараметрический критерий

**normality** ~ критерий нормальности

**omitted variables** ~ критерий пропущенных переменных

**one-sided** ~ односторонний критерий

**one-tail** ~ ° **one-sided** ~

**outer product of gradient** ~ критерий внешнего произведения градиента

**over-identifying restrictions** ~ критерий сверхидентифицирующих ограничений

**parameter constancy** ~ критерий постоянства параметров

**parameter-free** ~ свободный от параметра критерий

**predictive failure** ~ критерий [не]адекватности предсказаний

**preliminary** ~ предварительный критерий

**randomization** ~ критерий рандомизации

**rank** ~ ранговый критерий

**runs** ~ серии критерий

**score** ~ критерий,???

**sign** ~ критерий знаков

**specification** ~ критерий правильности спецификации

**two-sided** ~ двусторонний критерий

**two-tail** ~ ° **two-sided** ~

**unbiased** ~ несмещенный критерий

**uniformly most powerful** ~ равномерно наиболее мощный критерий

**unit root** ~ критерий единичных корней

**variable addition** ~ критерий добавления переменных

**variable deletion** ~ критерий удаления переменных

**Wald** ~ критерий Вальда

**White's** ~ критерий Уайта

testable поддающийся проверке

testing проверка, проверка гипотез, тестирование

**hypothesis** ~ проверка гипотез

**sequential** ~ последовательная проверка гипотез

theorem теорема

**~ of total probability** формула полной вероятности

**Bayes** ~ теорема Байеса

**central limit** ~ центральная предельная теорема

**Cramer** ~ теорема Крамера

**Gauss-Markov** ~ теорема Гаусса-Маркова

**Slutsky's** ~ теорема Слуцкого

theory теория

**asymptotic** ~ асимптотическая теория

**threshold** порог, критический уровень

**time**

**survival** ~ ???

**time-dependent** зависящий от времени {parameter}

**time-ordered** упорядоченный по времени

**time-series** временной ряд {cross-section of ~ } || относящийся к временным рядам

**time-varying** меняющийся во времени (☐ **time-dependent**) {parameter}

**tobit** тобит

**tool** инструмент

**econometric ~s** эконометрический инструментарий, эконометрические методы

**trace** след (матрицы) {statistic} || прослеживать

**trade-off** обратная зависимость (☐ **negative relation**), альтернатива, выбор, компромисс

**bias-variance** ~ обратное отношение между смещением и дисперсией (оценки)

**power-size** ~ обратное отношение между мощностью и размером (критерия)

**transform** преобразовывать, трансформировать || преобразование, результат преобразования

**Fourier** ~ преобразование Фурье

**transformation** преобразование {function}

**Box-Cox** ~ преобразование Бокса-Кокса

**cointegrating** ~ коинтегрирующее преобразование

**Koyck** ~ преобразование Койка

**linear** ~ линейное преобразование

**logarithmic** ~ логарифмическое преобразование

**normalizing** ~ нормализующее преобразование

**orthogonal** ~ ортогональное преобразование

**Prais-Winsten** ~ преобразование Прейса-Уинстена

**square root** ~ преобразование квадратного корня

**variance-stabilizing** ~ преобразование, стабилизирующее (уравнивающее) дисперсию

**translog** транслоговый {*model*}

**transitional** переходный, промежуточный

**trend** тренд, тенденция {*line, stationary*}

**common** ~ общий тренд (☐ **cointegration**)

**cyclic(al)** ~ циклический тренд

**deterministic** ~ детерминированный тренд

**downward** ~ убывающий тренд, тенденция к понижению

**exponential** ~ экспоненциальный тренд

**linear** ~ линейный тренд

**multiplicative** ~ мультипликативный тренд

**polynomial** ~ полиномиальный тренд

**quadratic** ~ квадратичный тренд

**stochastic** ~ стохастический тренд

**upward** ~ возрастающий тренд, тенденция к росту

**trending** имеющий тренд (о переменной)

**trial** испытание, опыт, проба

**Bernoulli ~s** испытания Бернулли

**independent ~s** независимые испытания

**true** истинный {*hypothesis, model, parameter, value*}

**truncate** усекать, отбрасывать

**truncated** усеченный

**truncation** усечение

**incidental** ~ ???

**lag** ~ усечение лага, отбрасывание лагов {length}

**two-factor** двухфакторный

**two-sample** двухвыборочный

**two-sided** двусторонний (о критерии) {test}

**two-tailed**  **two-sided**

## U

**unbiased** несмещенный (См. тж. **biased**) {estimate, (best linear, minimum-variance)~ estimator, expectation test}

**unbiasedness** несмещенность

**asymptotic** ~ асимптотическая несмещенность

**uncentred** нецентрированный

**unconditional** безусловный {distribution, expectation, mean}

**uncorrelated** некоррелированный

**undated** недатированный, без дат

**under-differencing** ???

**under-estimate** недооценивать, давать заниженную оценку || заниженная оценка, недооценка

**underlying** лежащий в основе

**under-predict** давать заниженное предсказание

**under-smoothed** недосглаженный

**uniform** равномерный, однородный {distribution}

**uniformly** равномерно, однородно {most powerful}

**unit** единичный {elasticity, root, variance, vector} || единица, элемент

**~ of measure** единица измерения

**economic** ~ экономическая единица, хозяйственная единица

**observation** ~ единица наблюдения

**sample** ~ элемент выборки

unique единственный

univariate одномерный

unobservable ненаблюдаемый {variable}

unobservable [variable, factor] ненаблюдаемая переменная

unrestricted неограниченный, без ограничений, безусловный {reduced form, estimate, variable }

unrestrictedly без ограничений, неограниченно

unstable неустойчивый

update обновлять (напр. данные)

upward направленный вверх, движущийся вверх {bias, drift, trend}

## V

valid действительный, сохраняющий силу, обоснованный

~ **in large samples** имеющий силу в больших выборках???

**statistically** ~ статистически обоснованный

validity действительность, законность, обоснованность

value значение

**actual** ~ фактическое значение

**anomalous** ~ аномалия, аномальные значения

**approximate** ~ приближенное значение

**asymptotic** ~ асимптотическое значение

**average** ~ среднее [значение]

**critical** ~ критическое значение

**estimated** ~ оценка, оцененное значение, расчетное значение

**expected** ~ ожидаемое значение, математическое ожидание

**fitted** ~ расчетное значение, подобранное значение



**initial** ~ исходное (начальное) значение

**mean** ~ среднее [значение], математическое ожидание

**median** ~ медиана

**missing** ~ отсутствующее значение, пропуск

**observed** ~ наблюдаемое значение

**P-** ~  **probability** ~

**predicted** ~ предсказанное значение

**probability** ~ ??? ( **significance level**)

**sample** ~ выборочное значение

**singular** ~ сингулярное значение, сингулярное число (матрицы)

**standardized** ~ нормированная величина

**starting** ~ начальное значение ( **initial** ~ )

**stationary** ~ стационарное значение

**table** ~ табличное значение

**true** ~ истинное значение

**variability** изменчивость

**variable** переменная, величина {addition, deletion, errors in ~s} || изменяющийся {parameter} I to drop a ~ опустить переменную, не включить переменную

**artificial** ~ искусственная переменная

**auxiliary** ~ вспомогательная переменная

**binary** ~ бинарная переменная, двоичная переменная (принимаящая только два значения,  **dummy**)

**cointegrated ~s** коинтегрированные переменные

**concomitant** ~ сопутствующая переменная

**controllable** ~ управляемая переменная

**constructed** ~ сконструированная переменная

**dependent** ~ зависимая переменная

**deterministic** ~ детерминированная переменная

**dichotomous** ~ дихотомическая переменная (☐ **binary** ~ )

**discrete** ~ дискретная переменная

**dummy** ~ фиктивная переменная (См. **dummy**)

**endogenous** ~ эндогенная переменная

**excluded** ~ исключенная переменная

**exogenous** ~ экзогенная переменная

**explanatory** ~ объясняющая переменная (☐ **independent** ~ )

**independent** ~ независимая переменная (См. **regressor**)

**indicator** ~ индикаторная переменная (☐ **dummy**)

**instrumental** ~ инструментальная переменная `{estimator}`

**instrumental ~s [method]** метод инструментальных переменных

**lagged** ~ запаздывающая переменная, переменная с лагом

**latent** ~ скрытая переменная (☐ **unobservable** ~ )

**leading** ~ опережающая переменная

**limited dependent** ~ ограниченная зависимая переменная `{model}`

**omitted** ~ пропущенная переменная `{~s test}`

**predetermined** ~ предопределенная переменная

**proxy** ~ эрзац-переменная (См. **proxy**)

**qualitative dependent** ~ качественная зависимая переменная `{model}`

**random** ~ случайная переменная, случайная величина

**redundant** ~ излишняя переменная

**response** ~ переменная-отклик

**seasonal** ~ сезонная переменная

**stationary** ~ стационарная переменная

**stochastic** ~ случайная переменная, случайная величина

**unrestricted** ~ свободная переменная

**unobservable** ~ ненаблюдаемая переменная

**vector random** ~ векторная случайная величина, случайный вектор

**variance** дисперсия, второй центральный момент {analysis of ~ , matrix, operator, ratio, reduction, stabilization}  **about mean** дисперсия относительно среднего, ~ **about regression** дисперсия относительно регрессии

**asymptotic(al)** ~ асимптотическая дисперсия

**bounded** ~ ограниченная дисперсия

**conditional** ~ условная дисперсия

**error** ~ дисперсия ошибки

**generalized** ~ обобщенная дисперсия

**limiting** ~ предельная дисперсия

**relative** ~ относительная дисперсия

**residual** ~ остаточная дисперсия

**sample** ~ выборочная дисперсия

**unequal** ~ неодинаковая дисперсия ( **heteroscedasticity**)

**unit** ~ единичная дисперсия

**variate** случайная величина, случайная переменная || изменяться, отклоняться

**antithetic** ~ дополнительная, дополняющая случайная величина

**control** ~ ??? случайная величина

**variation** вариация, разброс, варьирование, коэффициент вариации, изменение, отклонение {coefficient of ~ , source of ~ }

**explained** ~ объясненная вариация

**excess** ~ избыточная вариация

**random** ~ случайная вариация, случайное изменение

**seasonal ~s** сезонные колебания

**total** ~ общая вариация

vary менять(ся), изменять(ся)

varying переменный, изменяющийся

vector вектор {autoregression, differentiation, random variable}

~ **of ones** вектор, состоящий из единиц

**cointegrating** ~ коинтегрирующий вектор

**cointegration** ~ ° **cointegrating** ~

**column** ~ вектор-столбец

**gradient** ~ вектор-градиент

**normalized** ~ нормированный вектор

**null** ~ нулевой вектор

**random** ~ случайный вектор

**raw** ~ вектор-строка

**score** ~ ???

**standardized** ~ нормированный вектор

**unit** ~ единичный вектор

**zero** ~ нулевой вектор

verification проверка, верификация

verify проверять, подтверждать, верифицировать

versus против, в сравнении с

violation нарушение

~ **of assumptions** нарушение предположений

volatile изменчивый

volatility изменчивость, непостоянство

**stochastic** ~ ??

W

## walk

**random** ~ случайное блуждание {process}

**random ~ with drift** случайное блуждание с дрейфом???

wavelet (небольшая волна)???

weight вес

**lag ~s** веса лага

weighted взвешенный {average}

weighting взвешивание

whiten очищать, отбеливать, превращать в белый шум???

whitening очистка, отбеливание, превращение в белый шум???

width ширина

**window** ~ ширина окна

window {bandwidth of a ~ , width}

**Bartlett** ~ окно Бартлетта

**frequency** ~ частотное окно

**lag** ~ лаговое окно

**Parzen** ~ окно Парзена

**smoothing** ~ окно сглаживания???

**spectral** ~ спектральное окно

**Tukey** ~ окно Тьюки

## Y

yearly ежегодный, годовой

## Z

zero нуль || нулевой {restriction, vector}

