

Аннотация дисциплины

ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЕ ИССЛЕДОВАНИЯ

Цель дисциплины: - «Эконометрические исследования» формирование у студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 «Экономика» профиль «Учет, анализ, аудит» следующих компетенций: способность анализировать и прогнозировать основные социально-экономические показатели, предлагать стратегические направления экономического развития;

- способность управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла;
- способность проводить научные исследования, оценивать и оформлять их результаты.

Место дисциплины в структуре ООП:

Дисциплина «Эконометрические исследования» относится к модулю дисциплин инвариативных для направления подготовки, отражающих специфику ВУЗа направления подготовки 38.04.01-Экономика, магистерская программа «Бизнес-аналитика».

Краткое содержание:

Основные этапы эконометрического исследования. Новое в данной профессиональной области. Необходимые сведения из теории вероятностей и математической статистики. Характеристики статистической связи между экономическими переменными модели, используемые при их отборе в спецификацию. Мультиколлинеарность. Исследование нарушений стандартных предпосылок эконометрических моделей при помощи тестов, реализованных в специализированных пакетах. Учёт структурных изменений в экономических процессах при помощи моделей с фиктивными переменными. Оценка и прогнозирование эндогенных переменных в моделях с гетероскедастичностью. Оценка и прогнозирование эндогенных переменных в моделях с автокорреляцией. Оценка эконометрических моделей с ограничениями на параметры. Алгоритм оценки регрессионных моделей с ограничениями на параметры. Проверка гипотез в линейных моделях с ограничениями. Исследование моделей на панельных данных. Типы регрессионных моделей на панельных данных. Тестирование характера эффектов. Линейная вероятностная модель. Модели бинарного и множественного выбора.