**Аннотация дисциплины**

**Эконометрика**

Цель дисциплины — обучение студентов основным эконометрическим

методам, навыкам построения эконометрических моделей в Excel и

программной среде R, и их применения в конкретных областях экономики.

Краткое содержание:

Эконометрика: основные понятия и определения. Классическая

множественная регрессионная модель. Интервальные оценки и показатели

качества. Гетероскедастичность случайного возмущения. Автокорреляция

случайного возмущения. Мультиколлинеарность в регрессионных моделях.

Нелинейные регрессионные модели. Ошибки спецификации и ошибки

измерений переменных в регрессионных моделях. Фиктивные переменные в

эконометрических моделях. Динамические модели в эконометрике.

Стохастические регрессоры. Системы одновременных уравнений. Модели

временных рядов.