

Аннотация дисциплины

Эконометрика

Цель дисциплины:

изучения дисциплины «Эконометрика» состоит в приобретении теоретических знаний и формировании практических навыков в разработке регрессионных моделей финансово-экономических объектов, достаточных для освоения соответствующих разделов дисциплин учебных программ.

Краткое содержание:

Эконометрика, ее задачи и методы. Отражение в модели фактора времени. Отражение в модели влияния неучтенных факторов. Схема построения эконометрических вероятностей. Необходимые сведения из теории вероятностей. Необходимые сведения и теории математической статистики. Оптимальные статистические процедуры оценивания линейных моделей множественной регрессии. Тестирование предпосылок теоремы Гаусса-Маркова. Характеристики и модели временных рядов. Линейные регрессионные модели с гетероскедатичными и автокоррелированными остатками. Показатели качества регрессии. Прогнозирование значений эндогенной переменной линейной модели и проверка ее адекватности. Нелинейные модели регрессии и линеаризация. Ошибки спецификации эконометрических моделей. Модели с лаговыми переменными и проблема мультиколлинеарности. Линейные эконометрические модели из одновременных уравнений.