

Аннотация к рабочей программе 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.