

Аннотация дисциплины

Эконометрические исследования

Цель дисциплины:

- дать магистрантам современные теоретические знания и сформировать практические навыки в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей, достаточные для проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере.

Место дисциплины в структуре ОП:

Дисциплина «Эконометрические исследования» является дисциплиной обязательной части основной образовательной программы и входит в модуль дисциплин, инвариантных для направления подготовки отражающих специфику филиала (Блок 1. Дисциплины (модули)) для направления подготовки 38.04.01 «Экономика», магистерская программа «Налогов. Бухгалтерский учет. Налоговый консалтинг», отражающих специфику филиала.

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.