

## Аннотация дисциплины

### Эконометрические исследования

**Рабочая программа дисциплины** предназначена для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 «Экономика» профиль «Корпоративные финансы».

**Цель дисциплины:** «Эконометрические исследования» формирование у студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 «Экономика» профиль «Корпоративные финансы» следующих компетенций:

- способность анализировать и прогнозировать основные социально-экономические показатели, предлагать стратегические направления экономического развития (ПКН-6);
- способность управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла (УК-6);
- способность проводить научные исследования, оценивать и оформлять их результаты (УК-7).

**Место дисциплины в структуре ООП** - дисциплина «Эконометрические исследования» является дисциплиной обязательной части, модуля дисциплин, инвариантных для направления подготовки, отражающих специфику филиала программы магистратуры «Корпоративные финансы» направления 38.04.01 «Экономика».

**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.