

Аннотация дисциплины

«Эконометрика»

Цель дисциплины:

- приобретение теоретических знаний и формирование практических навыков в разработке регрессионных моделей финансово-экономических объектов, достаточных для освоения соответствующих разделов всех специальных и прикладных дисциплин учебных программ.

Место дисциплины в структуре ООП.

Дисциплина «Эконометрика» является дисциплиной обязательной части основной образовательной программы и входит в модуль общепрофессиональных дисциплин учебного плана по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» профиль «Финансы и кредит».

Краткое содержание.

Эконометрика, её задачи и методы. Отражение в модели фактора времени. Отражение в модели влияния неучтённых факторов. Схема построения эконометрических моделей. Линейная модель множественной регрессии. Необходимые сведения из теории вероятностей. Необходимые сведения из математической статистики. Оптимальные статистические процедуры оценивания линейных моделей множественной регрессии. Тестирование предпосылок теоремы Гаусса-Маркова. Характеристики и модели временных рядов. Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными 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.