

Аннотация дисциплины

«Эконометрика»

Цель дисциплины: формирование системы теоретических знаний и практических навыков применения эконометрических моделей и методов при решении профессиональных экономических задач.

Место дисциплины в структуре ООП: дисциплина относится к дисциплинам цикла математики и информатики учебного плана ООП по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, образовательная программа «Экономика и финансы».

Краткое содержание: Эконометрика, её задачи и методы. Отражение в модели фактора времени. Схема построения эконометрических моделей. Линейная модель множественной регрессии. 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.