

Аннотация дисциплины

«Эконометрика (продвинутый уровень)»

Цель дисциплины:

формирование у студентов современных теоретических знаний и практических навыков в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей финансово-экономических объектов, достаточных для изучения всех специальных и прикладных дисциплин учебных программ, а также проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере. Формирование навыков построения и анализа эконометрических моделей финансово-экономических объектов и процессов с привлечением современного эконометрического пакета Eviews.

Место дисциплины в структуре ООП.

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый уровень)» является дисциплиной части, формируемой участниками образовательных отношений, и входит в модуль дисциплин, инвариантных для направления подготовки, отражающих специфику филиала, учебного плана по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика», направленность программы магистратуры «Налоги. Бухгалтерский учет. Налоговый консалтинг».

Краткое содержание.

Эконометрика, её задача и метод. Новое в данной профессиональной области. Необходимые сведения из теории вероятностей. Необходимые сведения из математической статистики. Статистические процедуры оценивания линейных эконометрических моделей. Тестирование гипотез о свойствах случайных остатков в линейных эконометрических моделях. Модели стационарных и нестационарных временных рядов и их идентификация. Линейные эконометрические модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками. Нелинейные эконометрические модели. Эконометрические модели в виде одновременных уравнений. Модели на панельных данных