

Аннотация дисциплины

Эконометрика

Цель дисциплины

- обучение студентов основным эконометрическим методам, навыкам построения эконометрических моделей в Excel и программной среде R, и их применения в конкретных областях экономики.

Место дисциплины в структуре ОП (Б.1.1.2.5): является базовой дисциплиной цикла математики и информатики обязательной части для направления подготовки 38.03.01 Экономика, ОП Финансовая разведка, управление рисками и экономическая безопасность, профиль «Анализ рисков и экономическая безопасность» (программа подготовки бакалавров).

Краткое содержание дисциплины

Эконометрика: основные понятия и определения. Классическая множественная регрессионная модель. Интервальные оценки и показатели качества. Гетероскедастичность случайного возмущения. Автокорреляция случайного возмущения. Мультиколлинеарность в регрессионных моделях. Нелинейные регрессионные модели. Ошибки спецификации и ошибки измерений переменных в регрессионных моделях. Фиктивные переменные в эконометрических моделях. Динамические модели в эконометрике. Стохастические регрессоры. Системы одновременных уравнений. Модели временных рядов.