

АННОТАЦИЯ

«Эконометрические исследования»

Цель дисциплины

Основная цель - дать магистрантам современные теоретические знания и сформировать практические навыки в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей, достаточные для проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере.

Место в структуре ООП

Дисциплина «Эконометрические исследования» является вариативной дисциплиной профессионального цикла ОП по направлению 38.04.01 «Экономика» (магистратура) по магистерским программам, набор 2015 года: «Международные финансы и банки», «Международные финансы», «Международное налоговое планирование», «Налоги. Бухгалтерский учет. Налоговый консалтинг», «Международная экономика», «Международный бизнес», «Мировые финансы в глобальной экономике», «Аудит в международном бизнесе», «Аудит и финансовый консалтинг», «Бизнес-аналитика», «Бухгалтерский учет и правовое обеспечение бизнеса», «Международный учет и аудит», «Финансовый анализ в коммерческих организациях», «Финансовая конъюнктура рынка», «Бухгалтерский учет и финансовый менеджмент» (Институт заочного обучения)

Содержание программы

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.