

«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.

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.