

Аннотация дисциплины **«Эконометрические исследования»**

Цель дисциплины – формирование у студентов, следующих компетенций:

ПKN-6 способность анализировать и прогнозировать основные социально-экономические показатели, предлагать стратегические направления экономического развития;

УК-6 способность управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла;

УК-7 способность проводить научные исследования, оценивать и оформлять их результаты.

Место дисциплины в структуре ООП

дисциплина «Эконометрические исследования» является дисциплиной обязательной части модуля дисциплин, инвариантных для направления подготовки 38.04.01 «Экономика».

Краткое содержание дисциплины

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.