

Аннотация рабочей программы дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)»

Целью освоения дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» является дать магистрантам современные теоретические знания и практические навыки в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей финансово-экономических объектов, достаточные для изучения всех специальных и прикладных дисциплин учебных программ, а также проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере; способствовать формированию и усвоению знаний, умений, навыков в области экономической теории и практики, которые необходимы для работы в государственных и частных структурах, а также развития профессиональных качеств, компетенций, необходимых для выполнения функциональных обязанностей в сфере экономики.

Задачи дисциплины:

- ознакомить магистров с основами эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов;
- ознакомить магистров с проблемами, возникающими при практическом применении различных количественных моделей экономической теории;
- привить умение самостоятельно изучать научную литературу по эконометрическим методам исследования;
- выработать навыки свободного владения математическим и инструментальным аппаратом при обработке и интерпретации статистических данных.

В результате освоения дисциплины обучающиеся изучат теоретический и практический материал по следующим основным темам:

1. Методология эконометрического исследования (Эконометрика как один из подходов к анализу структурированных данных).
2. Классическая линейная регрессионная модель.
3. Регрессионный анализ при нарушении условий теоремы Гаусса-Маркова и предположения о нормальности. Оценивание моделей по временным рядам.
4. Модели с дискретными зависимыми переменными. Инструментальные переменные в линейной модели. Модели анализа панельных данных.

Объем дисциплины 3 з. е.

Форма промежуточного контроля – экзамен.