

ОБРАЗЕЦ ЗАПОЛНЕНИЯ МЕТАДААННЫХ ЭЛЕКТРОННОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО РЕСУРСА ДЛЯ ПРОГРАММ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ

Эконометрика

**Институт управления, экономики и финансов, общеэкономический факультет,
кафедра статистики, эконометрики и естествознания**

Направление: 080100.68 «Экономика» (магистерские программы «Учет, анализ и аудит», «Экономика фирмы», «Управленческий учет и контроллинг» и «Финансы и финансовые институты»)

Учебный план: «Налоги и налогообложение» (очное, 2013)

Дисциплина: «Эконометрика» (магистратура, 1 курс, очное обучение)

Количество часов: 108 ч. (в том числе: лекции – 14, практические занятия – 30, самостоятельная работа – 64), форма контроля: дифференцированный зачет.

Аннотация: *Основное внимание в ЭОР уделяется построению эконометрических моделей на основе пространственных данных и временных рядов. Приводятся краткие методические положения, включающие основные понятия, определения, формулы. Рассмотрены примеры решения типовых задач, представлены процедуры, математический аппарат и программные средства моделирования задач эконометрического анализа.*

Темы:

1. Классическая линейная модель множественной регрессии и обычный метод наименьших квадратов (МНК).

2. Обобщенный МНК. Точечные оценки и проверка гипотез для малых и больших выборок.

3. Неопределенность при спецификации модели и выбор спецификации.

4. Гетероскедастичность.

5. Автокорреляция.

6. Лаговые зависимые переменные и автокорреляция.

7. Анализ моделей с качественными или цензурированными зависимыми переменными.

8. Основные модели панельных данных.

9. Системы одновременных уравнений.

Ключевые слова: *временной ряд, множественная регрессия, регрессионный анализ, гетероскедастичность, автокорреляция, лаговая переменная*

Автор ЭОР: Иванов Иван Иванович, профессор кафедры статистики, эконометрики и естествознания, доктор экономических наук, тел.: (843) _____, email: _____.

Дата начала эксплуатации: 1 сентября 2016 г.