

## **Аннотация дисциплины**

### **Эконометрические исследования**

#### ***Цель дисциплины:***

Дать бакалаврам 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 дисциплиной вариативной части основной образовательной программы и входит в профильный блок дисциплин по выбору для направления подготовки 38.03.05 - Бизнес-информатика, профиль: ИТ - менеджмент в бизнесе.

#### ***Краткое содержание:***

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.