

«ЭКОНОМЕТРИКА»

Цель освоения дисциплины: обеспечить студентов необходимыми материалами для овладения дисциплиной, дать представление о применении методов математической статистики в моделировании экономических систем, сформировать навыки работы обработки статистических данных и построения моделей с использованием современного программного обеспечения.

Основные разделы дисциплины: Линейная модель множественной регрессии. Метод наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК. Показатели качества регрессии. Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК). Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные). Нелинейные модели регрессии и их линеаризация. Характеристики временных рядов. Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их идентификация. Система линейных одновременных уравнений. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.