

ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ ПРОГРАММА

38.03.01 – Экономика

(профиль «Мировая экономика»)

Аннотация рабочей программы дисциплины «Эконометрика»

Общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зач. единиц, 180 часов, форма промежуточной аттестации – экзамен.

Программой дисциплины предусмотрены лекционные занятия – 34 часа, лабораторные работы – 34 часа, самостоятельная работа обучающегося составляет 112 часов. Предусмотрено выполнение РГЗ.

Дисциплина предусматривает изучение следующих основных разделов: Экономические модели и статистические методы. Точечные оценки. Характеристики случайных величин. Применение ковариации, дисперсии и корреляции для эконометрических расчетов. Классическая нормальная модель парной линейной регрессии. Свойства коэффициентов регрессии и проверка гипотез. Статистический анализ модели линейной регрессии. Многофакторная регрессия. Гетероскедастичность. Автокорреляция. Нелинейные модели. Основные методы линеаризации нелинейных моделей. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные). Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их идентификация. Системы одновременных уравнений.