

Европейский университет в Санкт-Петербурге
Программа дистанционного обучения

Курс "Введение в эконометрику"

Цель курса: познакомить слушателей с основными понятиями эконометрики, научить пользоваться базовым эконометрическим инструментарием (простейшими моделями, аналитическими методами) и современными пакетами для статистической обработки данных.

Организация курса: слушатели должны в установленные сроки выполнить 6 домашних заданий. Для отдельных категорий слушателей возможно проведение итогового экзамена. Это ограничение связано с тем, что прием экзамена по электронной почте не проводится: необходимо личное присутствие.

Содержание курса:

- Эконометрика и ее задачи;
- Специфика эконометрических данных, основные требования к данным, источники данных;
- Современные компьютерные пакеты для статистической обработки данных и их особенности;
- Модель множественной линейной регрессии и модели, сводящиеся к ней;
- МНК-оценивание;
- Проверка простых гипотез и проверка линейных гипотез общего вида;
- Коэффициент детерминации и качество прогноза;
- Теорема Гаусса-Маркова;
- Индикаторные переменные в линейной модели;
- Гетероскедастичность и мультиколлинеарность;

Основной учебник:

- 1) С. С. Валландер. Заметки по эконометрике. СПб. 2001.
(www.eu.spb.ru/econ/regions/econometrica.pdf)

Рекомендуемая литература:

- 2) Я. Р. Магнус, П. К. Катышев, А. А. Пересецкий. Эконометрика. Начальный курс. 3 изд. М.: Дело, 2000. --- 400 с.
- 3) С. А. Айвазян, В. С. Мхитарян. Прикладная статистика. Основы эконометрики: В 2-х тт. 2-е изд. 2001.
- 4) Н. Ш. Кремер. Теория вероятностей и математическая статистика. М.: Юнити. 2000. -- - 543 с.

Где достать литературу: пособие (1) Вы можете либо скачать его из Интернета (www.eu.spb.ru/econ/regions/econometrica.pdf). Книги (2-4) рекомендуем спрашивать в библиотеках города или в крупных магазинах, торгующих книгами по экономике. В Петербурге эти книги бывают, в частности, в доме технической книги на ул. Пушкинской и в Доме Книги на Невском проспекте.

Домашние задания: каждое из шести домашних заданий оцениваются по 100-балльной системе. Выставляется также общая оценка за домашние задания. На основании общей оценки принимается решение о допуске слушателя к экзамену.

Экзамен: По окончании курса возможна сдача письменного экзамена.

Итоговая оценка за курс: если слушатель сдает экзамен, то итоговая оценка будет состоять из оценки за экзамен (80 %) и общей оценки за домашние задания (20 %). Итоговая оценка будет переведена из стобальной системы в пятибалльную.

Сертификаты: Всем желающим будут выданы сертификаты об окончании курса (с экзаменом либо без экзамена). Наличие сертификата является плюсом при приеме на основную программу Европейского Университета в Санкт-Петербурге.