

«СТРАТЕГИРОВАНИЕ: ЭКОНОМЕТРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ»

Преподаватель: к.э.н., доцент М.В. Шаклеина

Место дисциплины в учебном плане: дисциплина по выбору, 3 семестр.

Цель освоения дисциплины: знакомство с существующими эконометрическими инструментами и моделями их практическое применение в процессе стратегирования

Краткое содержание дисциплины: Основные понятия стратегирования. Роль и место эконометрического анализа в стратегировании. Варианты применения эконометрического анализа в стратегировании. Особенности сбора и подготовки статистических данных. Понятие стационарности. Базовые эконометрические тесты для оценки качества модели. Модель векторной авторегрессии (VAR). Особенности применения VAR в стратегировании. Преимущества и недостатки применения VAR в стратегировании. Основные этапы построения модели векторной авторегрессии в стратегировании. Тест Грэнджера (Granger causality test). Функции импульсных откликов. Особенности применения ARDL в стратегировании. Основные допущения моделирования ARDL. Основные этапы построения ARDL в стратегировании. Основные случаи и их интерпретация. Преимущества и недостатки применения ARDL в стратегировании. Модель векторной корреляции ошибок (VECM). Специфика применения VECM в стратегировании. Основные этапы построения модели. Преимущества и недостатки. Модель нелинейной авторегрессии с распределенным лагом NARDL. Основные этапы построения.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетные единицы, 72 часа.

Язык преподавания: русский

Итоговый контроль по дисциплине: зачет