

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.08 ЭКОНОМЕТРИКА

Наименование образовательной программы: *Финансы и кредит*

Код и наименование специальности: *38.03.01 «Экономика»*

Форма обучения: *очная*

Планируемые результаты освоения дисциплины: Способен использовать инструментарий математического анализа для построения эконометрических моделей для решения прикладных задач. Способен использовать алгебраические методы для построения эконометрических моделей для решения прикладных задач. Способен использовать методы дифференциальных уравнений для решения прикладных задач. Способность применять эконометрические модели для статистического анализа данных. Способность применения знаний системного анализа на уровне хозяйствующих субъектов. Способен предлагать решения экономической проблемы с использованием информационных технологий.

Объем дисциплины: Учебная дисциплина Б1.О.08 «Эконометрика» относится к блоку обязательной части дисциплин. В соответствии с учебным планом, по очной форме обучения дисциплина осваивается в 5 и 6 семестрах, общая трудоемкость дисциплины в зачетных единицах составляет 360 часов (5 ЗЕТ).

По очной форме обучения количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем (по видам учебных занятий) – 132 часа (лекций – 64 часов, практических занятий – 64 часа, консультации на промежуточную аттестацию – 4 часа) и на самостоятельную работу обучающихся – 156 часов.

Структура дисциплины: *Тема 1. Эконометрика и ее связь с экономической теорией. Методология эконометрического исследования. Типы экономических данных. Тема 2. Модель парной линейной регрессии. Метод наименьших квадратов. Теорема Гаусса-Маркова. Тема 3. Проверка гипотез в модели парной линейной регрессии. Выбор “наилучшей” модели. Нарушение предпосылок теоремы Гаусса-Маркова. Регрессия без свободного члена. Тема 4. Модель множественной линейной регрессии. МНК. Теорема Гаусса-Маркова. Проверка выполнения стандартных предположений об ошибках в линейной модели наблюдений. Тема 5. Проверка гипотез и статистические выводы в модели множественной линейной регрессии. Тема 6. Нелинейные регрессионные модели. Тема 7. Оценка исследований, основанных на множественной регрессии. Тема 8. Стационарные временные ряды, Модели ARMA. Тема 9. Нестационарные временные ряды. Идентификация стационарных и нестационарных рядов в рамках моделей ARIMA. Тема 10. Регрессионный анализ для стационарных временных рядов. Динамические модели. Тема 11. Регрессионный анализ нестационарных временных рядов. Коинтеграция и модели коррекции ошибками. Тема 12. Модели панельных данных. Тема 13. Модели с ограниченной зависимой переменной.*

Форма промежуточной аттестации: *экзамен, зачет с оценкой*

Основная литература:

1. Галочкин, В. Т. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / В. Т. Галочкин. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 293 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-14974-6. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/537080>

