

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Б1.О.02 ФИНАНСОВАЯ ЭКОНОМЕТРИКА

**Наименование образовательной программы:** *Финансовый менеджмент*

**Код и наименование направления подготовки:** *38.04.08 Финансы и кредит*

**Форма обучения:** *очная*

- **Планируемые результаты освоения дисциплины:** знает основные теоретические положения: риск, неопределенность, факторы неопределенности; знает программное обеспечение, используемое при решении практических задач эконометрическими методами; оценивает эффективность предложений по развитию объекта исследования с учетом фактора неопределенности; применяет информационные технологии при решении практических задач эконометрическими методами владение навыками обоснования применения различных методов моделирования; использует математические методы и закономерности экономической науки для подготовки и обоснования решений в профессиональной деятельности

**Объем дисциплины:** общая трудоемкость дисциплины составляет 5 з.е. (180 а.ч.), количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся: 1. очная форма обучения: лекции – 32 а.ч., практические занятия – 32 а.ч., самостоятельная работа – 78 ч.,

**Структура дисциплины:** *Тема 1. Регрессионный анализ и эндогенность. Тема 2 Оценка систем уравнений. Тема 3. Модели панельных данных. Тема 4. Нелинейные модели и отбор* *Тема 5. Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA. Тема 6. Причинность и блочная экзогенность. Тема 7. Методология векторных авторегрессий (VAR). Тема 8. Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана. Байесовские VAR. Тема 9. Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью Тема 10. Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни. Тема 11. Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов.*

**Форма промежуточной аттестации:** зачет с оценкой.

#### **Основная литература:**

1. Мардас, А. Н. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / А. Н. Мардас. — 2-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2022. — 180 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8164-3. — Режим доступа : <https://urait.ru/viewer/ekonometrika-490427#page/2>
2. Кремер, Н. Ш. Эконометрика : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; под ред. Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2022. — 308 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08710-. — Режим доступа : <https://urait.ru/viewer/ekonometrika-488678#page/2>
3. Галочкин, В. Т. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / В. Т. Галочкин. — М. : Издательство Юрайт, 2022. — 293 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-14974-. — Режим доступа <https://urait.ru/viewer/ekonometrika-490094#page/2>