

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.15 ЭКОНОМЕТРИКА

Наименование образовательной программы: *Финансы и кредит*

Код и наименование специальности: 38.03.01 «Экономика»

Форма обучения: *очная, заочная*

– **Планируемые результаты освоения дисциплины:** знает основы математической статистики, необходимые для анализа и оценки информации при решении типовых математических задач; использует знания при определении и характеристики типа проекта применяет навыки аппарата математической статистики для решения типовых математических задач; применяет аппарат математической статистики для решения типовых математических задач; применяет эконометрические методы для решения прикладных задач; 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., 2. заочная форма обучения: лекции – 24 а.ч., практические занятия – 24 а.ч., самостоятельная работа – 126 ч., контроль – 4 ч.

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.

Форма промежуточной аттестации: зачет с оценкой

Основная литература:

1. Сток, Д. Введение в эконометрику / Д. Сток, М. Уотсон ; пер. с англ. ; под науч. ред. М.Ю. Турунцевой. — Москва : Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2015. — 864 с. — (Академический учебник). - ISBN 978-5-7749-0865-3. - Режим доступа: <https://new.znaniium.com/catalog/product/1043159>

2. 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. Путько ; под ред. Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — М. :

Издательство Юрайт, 2022. — 308 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08710-9. — 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 978-5-534-14974-6. — Режим доступа <https://urait.ru/viewer/ekonometrika-490094#page/2>