

**АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ****Б1.О.09 «Эконометрика»***наименование дисциплины***Наименование образовательной программы:** «Финансы и кредит»**Код и наименование направления подготовки:** 38.03.01 Экономика**Форма обучения:** очная**Планируемые результаты освоения дисциплины:**

Дисциплина Б1.О.09 «Эконометрика» обеспечивает овладение следующими компетенциями:

<b>Код компетенции</b>	<b>Наименование компетенции</b>
ОПК ОС-4	Способен применять эконометрические методы для решения прикладных задач

**Объем дисциплины:** 10 з. е, 360 акад. часов.**Структура дисциплины:****Очная форма обучения**

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.

**Формы промежуточной аттестации: экзамен.**

**Основная литература:**

**7.1. 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>

**7.2. Дополнительная литература**

1. Демидова, О. А. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / О. А. Демидова, Д. И. Малахов. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 392 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-18948-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/555532> Эконометрика : учебник для вузов / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535449>