

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:

| Код компетенции | Наименование компетенции |
|-----------------|---|
| 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:

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. Носко В.П. Эконометрика Книга 1, Ч.1,2: учебник. — М.: Дело, 2011. — 672 с.