

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Б1.О.03 ЭКОНОМЕТРИКА (продвинутый уровень)

**Наименование образовательной (магистерской) программы:** *Учет, анализ, аудит*

**Код и наименование направления подготовки:** *38.04.01 Экономика*

**Форма обучения:** *заочная*

**Планируемые результаты освоения дисциплины:** *Способность применять эконометрические методы для оценки эффективности проектов: знание основных теоретических положений: риск, неопределенность; оценка эффективности проектов с учетом фактора неопределенности по результатам решения эконометрических задач; анализ и интерпретация полученных результатов. Способность применять эконометрические методы для разработки стратегии поведения экономических субъектов на различных рынках; знание основных теоретических положений: риск, неопределенность, факторы неопределенности; оценка эффективности предложений по развитию объекта исследования с учетом фактора неопределенности; владение навыками обоснования применения различных методов моделирования. Способность применять эконометрические методы для разработки стратегии поведения экономических субъектов на конкретных различных рынках. Способность отбирать материалы для решения конкретных практических задач с применением эконометрических моделей.*

**Объем дисциплины:** *общим объемом 180 часов (5 ЗЕТ) изучается по заочной форме – на первом курсе. Количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем (по видам учебных занятий) – 34 часов (лекций – 12 часов, практических занятий – 20 часов, консультация – 2 часа), на самостоятельную работу обучающихся – 137 часов, на контроль – 9 часов.*

**Структура дисциплины:** *Тема 1. Регрессионный анализ и эндогенность. Тема 2. Оценка систем уравнений. Тема 3. Модели панельных данных. Тема 4. Нелинейность 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. 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:** *экзамен.*

**Основная литература.**

1. Елисеева И. И. Эконометрика : учебник для вузов / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2023. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Режим доступа: <https://urait.ru/bcode/510472>

2. Мардас, А. Н. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / А. Н. Мардас. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 180 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8164-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/537389>

3. 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 978-5-534-08710-9. — Режим доступа : <https://urait.ru/viewer/ekonometrika-488678#page/2>

#### 7.2. Дополнительная литература

1. Басовский Л.Е. Эконометрика: учебное пособие. – М.: ИНФРА-М, 2022.-48 с. — ISBN 978-5-369-01569-8 (РИОР) — ISBN 978-5-16-105038-5 (Инфра-М, online) — Режим доступа: <https://znanium.com/read?id=380060>

2. 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>