

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:

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>