

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.15 Финансовая эконометрика

Наименование образовательной программы: *Финансовый менеджмент*

Код и наименование специальности: *38.04.08. «Финансы и кредит»*

Форма обучения: *очная*

Планируемые результаты освоения дисциплины: на уровне знаний: знает основные теоретические положения: риск, неопределенность, факторы неопределенности; знает программное обеспечение, используемое при решении практических задач эконометрическими методами; на уровне умений: оценивает эффективность предложений по развитию объекта исследования с учетом фактора неопределенности; применяет информационные технологии при решении практических задач эконометрическими методами; на уровне навыков: владение навыками обоснования применения различных методов моделирования; использует математические методы и закономерности экономической науки для подготовки и обоснования решений в профессиональной деятельности.

Объем дисциплины: общая трудоемкость дисциплины в зачетных единицах составляет 180 часов (5 ЗЕТ). По очной форме обучения количество академических часов, выделенных на контактную работу с преподавателем (по видам учебных занятий) – 66 часов (лекций – 32 часов, практических занятий – 32 часов, консультация – 2 часа), на самостоятельную работу обучающихся – 78 часов, на контроль – 36 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. 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>
2. Кремер, Н. Ш. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; под редакцией Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 308 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08710-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535528>