

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Эконометрика»

по основной профессиональной образовательной программе по направлению подготовки
38.03.01 «Экономика» (уровень бакалавриата)

Направленность (профиль): Цифровые финансы

Общий объем дисциплины – 4 з.е. (144 часов)

Форма промежуточной аттестации – Экзамен.

В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы компетенции с соответствующими индикаторами их достижения:

- ОПК-1.2: Решает прикладные задачи на основе положений экономической теории;
- ОПК-2.1: Способен выполнять обработку и статистический анализ данных;

Содержание дисциплины:

Дисциплина «Эконометрика» включает в себя следующие разделы:

Форма обучения очная. Семестр 5.

1. Введение в эконометрику. Эконометрика как результат взаимодействия и объединения трех компонент: : экономической теории, математики и статистики.

Эконометрические модели и их использование для обработки экономических данных. Спецификация модели. Оценка тесноты зависимости между переменными. Свойства коэффициента корреляции. Оценка значимости выборочного коэффициента корреляции. Мультиколлинеарность факторов. Классификация эконометрических моделей. Линейная регрессия. Фиктивные переменные..

2. Предпосылки регрессионного анализа. Условия Гаусса-Маркова. Проверка предпосылок построения классической линейной регрессионной модели: тест Голдфелда-Квандта, критерий Дарбина-Уотсона, первый коэффициент автокорреляции $r(1)$, R/S критерий..

3. Прогнозирование с помощью линейной модели. Точечный прогноз. Интервальная оценка. Расчет доверительных интервалов. Средние коэффициенты эластичности. Бета- коэффициенты (стандартизированные коэффициенты регрессии). Дельта- коэффициенты..

4. Прогнозирование экономических процессов с использованием временных рядов. Понятие и виды рядов динамики. Экстраполяция и интерполяция. Этапы построения прогноза по временным рядам .Оценка качества и точности построенных моделей. Построение точечных и интервальных прогнозов. Сезонные колебания..

5. Системы эконометрических уравнений. Классификация эконометрических систем. Условия идентификации эконометрических систем. Косвенный метод наименьших квадратов для построения эконометрических систем..

Разработал:

доцент

кафедры ПМ

М.А. Кайгородова

Проверил:

Декан ФИТ

А.С. Авдеев