

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Эконометрика»

по основной профессиональной образовательной программе по направлению подготовки
38.05.01 «Экономическая безопасность» (уровень специалитета)

Направленность (профиль): Экономическая безопасность организаций по отраслям и сферам деятельности (со специальной подготовкой)

Общий объем дисциплины – 3 з.е. (108 часов)

Форма промежуточной аттестации – Зачет.

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

- ОПК-6.1: Способен решать профессиональные задачи с использованием современных информационных технологий и программных средств;

Содержание дисциплины:

Дисциплина «Эконометрика» включает в себя следующие разделы:

Форма обучения очная. Семестр 4.

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