

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

НАИМЕНОВАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ Эконометрика

НАПРАВЛЕНИЕ 38.03.01 Экономика

ПРОФИЛЬ ПОДГОТОВКИ Финансы и кредит, Бухгалтерский учет, анализ и аудит

УРОВЕНЬ ОБРАЗОВАНИЯ бакалавриат

ОБЕСПЕЧИВАЮЩЕЕ ПОДРАЗДЕЛЕНИЕ Кафедра высшей математики

Цели освоения дисциплины: изучить теоретические основы и приобрести практический опыт по анализу и определению математических зависимостей между экономическими данными, построению эконометрических моделей.

Результаты обучения:

Знать:

- основные эконометрические методы анализа экономических данных.

Уметь:

- строить уравнение простой и множественной линейной регрессии;
- анализировать и строить системы эконометрических уравнений, анализировать временные ряды.

Владеть:

- методами эконометрического анализа экономических процессов, навыками построения эконометрических моделей.

Компетенции: ОК-7, ОПК-3, ПК-17, ПК-18, ПК-19.

Распределение по курсу и семестру:

Курс	Семестр	Лекции	Практики	Лабораторные работы	Курсовая работа	Вид промежуточной аттестации
2	4	17	9	8	-	зачет

Содержание дисциплины:

1. Простая линейная регрессия. Множественная регрессия. Проверка гипотез о значимости параметров регрессии, коэффициента корреляции и уравнения регрессии в целом. Явление мультиколлинеарности. Нелинейная регрессия. Обобщенный метод наименьших квадратов.

2. Системы эконометрических уравнений. Проблема идентификации. Косвенный метод наименьших квадратов. Двухшаговый метод наименьших квадратов.

3. Анализ временных рядов. Определение структуры временного ряда. Модели временных рядов. Спектральный анализ временных рядов. Динамические эконометрические модели.

Общая трудоемкость дисциплины:

3 зачетные единицы, 108 часов.