

## АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Эконометрика»

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

**Направленность (профиль):** Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

**Общий объем дисциплины** – 2 з.е. (72 часов)

**Форма промежуточной аттестации** – Зачет.

**В результате освоения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями:**

- ОПК-1: способностью применять математический инструментарий для решения экономических задач;
- ПК-28: способностью осуществлять сбор, анализ, систематизацию, оценку и интерпретацию данных, необходимых для решения профессиональных задач;
- ПК-30: способностью строить стандартные теоретические и эконометрические модели, необходимые для решения профессиональных задач, анализировать и интерпретировать полученные результаты;

**Содержание дисциплины:**

Дисциплина «Эконометрика» включает в себя следующие разделы:

**Форма обучения очная. Семестр 5.**

**1. Парная регрессия и корреляция.** Линейная модель парной регрессии. Метод наименьших квадратов (МНК). Существенность оценок параметров. Прогноз

Нелинейные модели и их линеаризация. Оценка качества нелинейных моделей..

**2. Модель множественной регрессии.** Принципы и способы отбора факторов в модель, показатели качества модели множественной регрессии.

**3. Предпосылки применения МНК.** Проверка выполнения предпосылок применения МНК. Косвенный МНК.

**5. Временные ряды.** Структура и особенности временных рядов. Методы обнаружения и устранения аномалий. Методы выявления тенденций.

Стационарные временные ряды. Понятие автокорреляции, автокорреляционной функции, лага, коррелограммы.

Сезонные колебания в мультипликативных и аддитивных моделях.

**6. Системы одновременных уравнений.** Условия идентифицируемости. Двухшаговый и трехшаговый МНК

Идентифицируемость систем эконометрических уравнений Обобщенный МНК.

Разработал:

доцент

кафедры ВМ

Проверил:

Декан ФИТ

Е.Г. Никифорова

А.С. Авдеев