

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 – 2 з.е. (72 часов)

Форма промежуточной аттестации – Зачет.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен обладать следующими компетенциями:

- ОПК-3: способностью выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы;

Содержание дисциплины:

Дисциплина «Эконометрика» включает в себя следующие разделы:

Форма обучения очная. Семестр 5.

1. Введение в эконометрику. 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

Проверил:

Декан ФИТ

М.А. Кайгородова

А.С. Авдеев