Аннотация рабочей программы учебной дисциплины

**"Эконометрика"**

образовательной программы «Экономика»

|  |  |
| --- | --- |
| **Краткое описание дисциплины** | Цель дисциплины - овладение обучающимися методологией определения устойчивых взаимосвязей в экономике по статистическим данным, построения, идентификации и применения эконометрических моделей. |
| **Компетенции, формируемые в результате освоения учебной дисциплины** | ПК-4, ПК-8, ПК-10. |
| **Методы обучения** | Лекции, семинарские занятия, самостоятельная работа обучающихся. |
| **Язык обучения** | Русский. |
| **Ожидаемые результаты обучения** | Знать: основные эконометрические модели, применяемые в экономических исследованиях; методы оценки параметров эконометрических моделей; принципы, методы определения и показатели качества эконометрических моделей, принципы и методы прогнозирования экономических параметров с помощью эконометрических моделей.  Уметь: строить простейшие эконометрические модели, определять оптимальный набор объясняющих экономических параметров, проводить идентификацию неизвестных коэффициентов эконометрических моделей различными методами, оценивать качество построенных моделей по статистическим данным, строить точечные и интервальные прогнозы экономических параметров с помощью эконометрических моделей, оценивать точность прогнозирования.  Владеть:навыками поиска, отбора и предварительной обработки статистических данных для проведения эконометрических исследований из различных источников, включая сетевые ресурсы сети Интернет; методами построения и идентификации эконометрических моделей; методами прогнозирования экономических параметров с помощью эконометрических моделей; методикой использования эконометрических моделей для управления экономическими процессами, при планировании, прогнозировании экономических параметров и в процессе проведения экономических исследований. |
| **Перечень разделов/тем дисциплины** | Дисциплина состоит из трех блоков.  **1) Модель множественной линейной регрессии.** Метод наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК. Показатели качества регрессии. Точечное и интервальное прогнозирование по уравнению регрессии. Анализ экономических временных рядов. Выделение линейного тренда, прогнозирование по тренду.  **2)** **Обобщенные модели регрессии.** Множественная линейная регрессия со случайными регрессорами.Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными ошибками. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК). Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные). Нелинейные модели регрессии и их линеаризация. Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их идентификация.  **3) Системы одновременных уравнений.** Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов. Важнейшие эконометрические модели микро- и макроэкономики. |
| **Используемые инструментальные и программные средства** | В процессе проведения исследовательской работы используются программные средства, имеющиеся в составе надстроек табличного процессора “Excel”, пакетов прикладных программ “Matstat” и “Statgraf”. |
| **Формы текущего контроля** | Защита проведенных исследовательских работ по моделям парной, множественной регрессии и макроэкономической модели в виде системы одновременных уравнений. |
| **Форма оценки окончательного результата обучения по дисциплине** | Зачет. |