|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| |  |  | | --- | --- | | **Название:** | **Эконометрика** | | **Авторы:** | [Артамонов Вячеслав Александрович](http://www.vavt.ru/prep/by_id/artamonov_va), [Криволапов Сергей Яковлевич](http://www.vavt.ru/prep/by_id/krivolapov_sy) | | **Подразделение:** | [Кафедра информатики и математики](http://www.vavt.ru/K_info) | | **Дата утверждения:** | 14.10.2016 | | **Издательство:** | - М.: ВАВТ (www.vavt.ru) | | **Категория учащихся:** | 3 курс |ФВМ Бакалавриат |очная форма | | http://vavt.ru/papkavavt.png |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Название файла** | **Объем (КБ)** | **Загрузка** |
| Эконометрика | 1924 kb |  |

**Аннотация**

**1. Цель дисциплины:**  
Целью преподавания дисциплины «Эконометрика» является приобретение студен­тами необходимых теоретических и практических знаний в области современных эконометрических методов анализа и моделирования экономики.  
В соответствии с назначением основными задачами курса являются:  
1. Ознакомление студентов с проблемами, возникающими при практическом применении различных количественных моделей экономической теории, та­ких как модели спроса, производства, совокупного потребления, инвестиций и др.  
2. Подготовка студентов к прикладным исследованиям в области экономики.  
3. Освоение методов эконометрического анализа статистических данных.  
4. Освоение методов построения и анализа эконометрических моделей.  
5. Овладение навыками применения пакетов компьютерных программ эконо­метрического анализа статистических данных.  
**2. Место дисциплины в структуре ООП:**  
Учебная дисциплина «Эконометрика» относится к профессиональному циклу Б.З ФГОС ВПО и рассчитана на один семестр. Для данного курса обязательно должны быть прослушаны дисциплины «Линейная алгебра», «Математический анализ», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Экономическая теория», «Микроэкономика» и «Макроэкономика».  
Материал курса может быть использован в других курсах, связанных с количе­ственным анализом реальных экономических явлений, при подготовке дипломных работ и магистерских диссертаций, использующих количественные методы анализа статистических данных и моделирование экономических процессов.  
**3. Требования к результатам освоении дисциплины:**  
Процесс изучения дисциплины направлен на формирование и развитие компетенций: ОК-3, ОК-6, ОК-9, ОПК-6, ОПК-7, ПК-10, ПК-21  
В результате изучения дисциплины студенты должны:  
• Владеть системными знаниями математических методов в экономике.  
• Владеть классическими приемами решения и исследования математически формализованных задач  
• Владеть основным математическим понятийным аппаратом.  
• Развивать логическое и алгоритмическое мышления  
• Владеть логической культуры аргументации и доказательств  
• Быть готовыми применять знания математических моделей в экономике для решения прикладных задач  
• Уметь применять полученные знания для решения прикладных задач экономики и финансов.  
° Выявлять и устранять пробелы в знаниях в стремлении к непрерывному самообучению и саморазвитию.  
• Знать направления современных исследований в области эконометрики  
• Уметь самостоятельно читать и анализировать литературу, как учебного, так и научного характера  
**4. Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 ча­сов).**  
**5. Семестр:**1  
**6. Основные темы дисциплины:**  
1. Линейная модель регрессии. Условия Гаусса - Маркова.  
2. Оценивание параметров линейной модели методом наименьших квадратров.  
3. Проверка гипотез относительно параметров модели и модели в целом.  
4. Проблема мультиколлинеарности в линейной регрессии.  
5. Проблема гетероскедастичности в линейной регрессии.  
6. Проблемы спецификации линейной регрессии.  
7. Линейная регрессия с автокоррелированной ошибкой.  
8. Модели нелинейной регрессии.  
9. Модели стационарных временных рядов.  
10. Линейная регрессия для стационарных временных рядов.  
11. Временные ряды, стационарные относительно тренда.  
**Авторы:**Артамонов Никита Вячеславович, кандидат физико-математических наук, доцент кафедры информатики и математики ВАВТ.  
Криволапов Сергей Яковлевич, кандидат физико-математических наук, доцент кафедры информатики и математики ВАВТ.

**Дата публикации в интернет: 08.02.2017**