

## **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

### **Б1.В.ДВ.05.02 ЭКОНОМЕТРИКА**

---

**Автор: Леонова М.**

**Направление 38.03.06 «Торговое дело», профиль «Международная коммерция:**

**Квалификация (степень) выпускника: бакалавр**

**Форма обучения: очная**

**Цель освоения дисциплины:** сформировать компетенции в области прогнозирования бизнес-процессов в профессиональной сфере и оценке их эффективности

#### **План курса:**

##### **Тема 1. Цели, предмет и задачи курса**

Определение эконометрики. Эконометрика и экономическая теория. Эконометрика и статистика. Эконометрика и экономико-математические методы. Области применения эконометрических моделей.

##### **Тема 2. Методологические вопросы построения эконометрических моделей. Инструментарий эконометрики. Этапы эконометрического моделирования.**

Обзор используемых методов. Простейшие примеры эконометрических моделей: модель предложения и спроса на конкурентном рынке, элементарная модель Кейнса, закон спроса, функция потребления. Классификация переменных в эконометрических моделях. Понятия спецификации и идентифицируемости модели. Эконометрические модели: общая характеристика, различия статистического и эконометрического подхода к моделированию. Типы данных в эконометрическом моделировании: пространственные выборки, временные ряды, панельные данные. Спецификация переменных в уравнениях регрессии. Ошибки спецификации. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Обобщенный метод наименьших квадратов. Информационное и программное обеспечение эконометрического анализа.

##### **Тема 3. Парная регрессия и корреляция.**

Понятие о функциональной, статистической и корреляционной связях. Основные задачи прикладного корреляционно-регрессионного анализа. Уравнение регрессии, его смысл и назначение. Выбор типа математической функции при построении уравнения регрессии.

Парная регрессия. Спецификация линейной модели парной регрессии. Метод наименьших квадратов – идентификация линейной модели парной регрессии - и условия его применения для определения параметров уравнения парной

##### **Тема 4. Множественная регрессия и корреляция.**

Понятие о множественной регрессии. Классическая линейная модель множественной регрессии (КЛММР). Определение параметров уравнения множественной

регрессии методам наименьших квадратов. Оценка качества модели множественной регрессии: F-критерий Фишера, t-критерий Стьюдента. Мультиколлинеарность.

#### **Тема 5. Системы эконометрических уравнений.**

Понятие экзогенных, эндогенных, лаговых и предопределенных переменных.

Три вида систем уравнений: система независимых уравнений, система рекурсивных уравнений, система взаимозависимых (совместных, одновременных) уравнений.

Проблема идентификации, правила идентификации, необходимое и достаточное условие.

Применение косвенного метода наименьших квадратов (КМНК).

#### **Тема 6. Временные ряды в эконометрических исследованиях**

Понятие временного ряда и его основные компоненты. Понятие автокорреляции и автокорреляционной функции. Построение аддитивной модели временного ряда. Построение мультипликативной модели временного ряда. Прогнозирование по результатам построения модели.

#### **Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:**

Промежуточная аттестация проводится в форме: письменного зачета с оценкой.

В рамках текущего контроля успеваемости студенты выполняют 4 проектных задания с защитой и опрашиваются в устной и письменной формах.

#### **Компетенция ПК – 14.1 (первый этап освоения) формирует на уровне знаний:**

- знание порядка описания бизнес-процессов и их оценки с учетом специфики сферы закупок с целью последующих эконометрических построений

#### **- на уровне умений:**

- умение применять эконометрические методы обоснования эффективности управленческих решений на уровне бизнес-процессов для разработки технико-экономического обоснования по установлению прямых производственных связей, созданию и развитию бизнеса на основе договоров и обоснования процедур закупок

#### **на уровне навыков:**

- владение навыками эконометрического обоснования эффективности бизнес-процессов для разработки технико-экономического обоснования по установлению прямых производственных связей, созданию и развитию бизнеса на основе договоров и обоснования процедур закупок

#### **Основная литература:**

1. Яковлева А.В. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Яковлева А.В.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Научная книга, 2012.— 223 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/6266>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Мхитарян В.С. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Мхитарян В.С., Архипова М.Ю., Сиротин В.П.— Электрон. текстовые данные.— М.: Евразийский открытый институт, 2012.— 224 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/11125>.— ЭБС «IPRbooks»
3. Кремер Н.Ш. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов/ Кремер Н.Ш., Путко Б.А.— Электрон. текстовые данные.— М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012.— 328 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/8594>.— ЭБС «IPRbooks»