

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.Б.03 ЭКОНОМЕТРИКА (ПРОДВИНУТЫЙ УРОВЕНЬ)

Автор: Ермаков Ю.А., к.ф-м.н., доцент

Код и наименование направления подготовки, направленности (профиля): 38.04.01 Экономика, профиль «Корпоративная экономика»

Квалификация (степень) выпускника: магистр

Форма обучения: очная, очно-заочная, заочная

Цель освоения дисциплины:

Цель дисциплины Б1.Б.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» дать магистрантам современные теоретические знания и сформировать практические навыки в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей финансово - экономических объектов, достаточные для изучения всех специальных и прикладных дисциплин учебных программ, а также проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере.

Основные задачи дисциплины «Эконометрика (продвинутый курс)»:

1) научить изучающих данную дисциплину принципам спецификации (описания) экономических объектов на языке математических моделей со случайными возмущениями, отражающими воздействие факторов, не включённых в модель;

2) изучить процедуры оценивания эконометрических моделей с гомоскедастичными, гетероскедастичными и автокоррелированными случайными возмущениями;

3) изучить процедуры прогнозирования значений объясняемых переменных эконометрических моделей в различных вероятностных схемах случайных возмущений;

4) изучить наиболее востребованные практикой модели стационарных и нестационарных временных рядов и их идентификацию, а также создать основу для разработки новых моделей временных рядов.

Код и этап освоения компетенций:

УК ОС-1 «Способность применять критический анализ и системный подход для решения профессиональных задач».

УК ОС-1.2.2 (этап 2) «Способность применять системный подход для решения профессиональных задач».

План курса:

Тема 1. Эконометрика, её задача и метод.

Тема 2. Элементы математической статистики

Тема 3. Статистические процедуры оценивания линейных эконометрических моделей

Тема 4. Тестирование гипотез о свойствах случайных остатков в линейных эконометрических моделях

Тема 5. Модели стационарных и нестационарных временных рядов и их идентификация

Тема 6. Линейные эконометрические модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками

Тема 7. Нелинейные эконометрические модели.

Тема 8. Эконометрические модели в виде одновременных уравнений.

Тема 9. Модели на панельных данных.

Формы текущего контроля и промежуточной аттестации:

Формы и методы текущего контроля успеваемости: опрос и тестирование по темам курса, решение практико-ориентированных заданий, выполнение лабораторной работы.

Форма промежуточной аттестации - экзамен.

Планируемые результаты обучения:

Знания:

- системного представления о развитии экономических процессов и явлений, а также деятельности конкретного хозяйствующего субъекта;
- системных методов и процедур при анализе деятельности хозяйствующего субъекта.

Умения:

- применять системный подход для описания хозяйствующего субъекта как элемента системы более высокого уровня для решения профессиональных задач;
- описывать подсистемы системы высокого уровня, в которые включен объект.

Навыки:

- навыками системного видения экономических и финансовых проблем в функционировании и развитии хозяйствующего субъекта;
- навыками системного подхода к оценке возможностей развития различных институтов рынка и принятия эффективных решений в нестандартных ситуациях.

Основная литература:

1. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры / И. И. Елисеева [и др.]; под ред. И. И. Елисеевой. — М.: Издательство Юрайт, 2017. — 449 с. — (Серия: Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Режим доступа: www.biblio-online.ru/book/CAD31DD6-D5BC-4549-B1C1-729B90A8E65B.
2. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры / И. И. Елисеева [и др.]; под ред. И. И. Елисеевой. — М.: Издательство Юрайт, 2017. — 449 с. — (Серия: Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Режим доступа: www.biblio-online.ru/book/CAD31DD6-D5BC-4549-B1C1-729B90A8E65B.