

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.05.02 ЭКОНОМЕТРИКА

Автор: Леонова М.

Направление 38.03.06 «Торговое дело», профиль «Управление финансами во внешнеэкономической деятельности»

Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины: сформировать компетенции в области прогнозирования бизнес-процессов в профессиональной сфере и оценке их эффективности; представления результатов своего интеллектуального труда и использования этих результатов в профессиональной деятельности

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 методом 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.

Компетенции ПК – 14 и ДПК-6 формируют 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»