

## АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

### Б1.Б.03 ЭКОНОМЕТРИКА (ПРОДВИНУТЫЙ УРОВЕНЬ)

**Автор:** Новикова Е.В. к.э.н., доцент

**Код и наименование направления подготовки, профиля:** 38.04.01 Экономика  
Профиль «Экономика и право»

**Квалификация (степень) выпускника:** магистр

**Форма обучения:** очная, очно-заочная

#### **Цель освоения дисциплины:**

Сформировать компетенцию в области знаний о методологии и методике построения и применения эконометрических моделей для моделирования и прогнозирования развития конкретных экономических процессов.: УК ОС-1.2.

#### **План курса:**

Тема 1 Оценка систем уравнений

Тема 2 Модели панельных данных

Тема 3 Нелинейные модели и отбор

Тема 4 Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA

Тема 5 Причинность и блочная экзогенность

Тема 6 Методология векторных авторегрессий (VAR)

Тема 7 Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана

Байесовские VAR

Тема 8 Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью

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

Код компетенции	Наименование компетенции	Код этапа освоения компетенции	Наименование этапа освоения компетенции
УК ОС-1	Способность применять критический анализ и системный подход для решения профессиональных задач	УК ОС-1.2	Способность применять системный подход для решения профессиональных задач

Результат формирования компетенции УК ОС-1.2 на уровне данной дисциплины обеспечивается путем формирования у обучающихся:

на уровне знаний:

на уровне знаний:

- основные направления и результаты исследований, публикуемых в ведущих журналах по исследованиям в эконометрике;

- перспективные методы эконометрического анализа;

- популярные программные продукты, применяемые для разработки и анализа эконометрических моделей;

на уровне умений:

- способность применять методы эконометрики для построения моделей и анализа задач, возникающих в микро- и макроэкономике, в сфере финансов;

- использовать программу Eviews для разработки эконометрических моделей и оценки их качества;

- на основе полученных моделей строить прогнозы развития конкретных экономических ситуаций.

на уровне навыков:

- владеть современными способами сбора данных;

- проводить самостоятельную исследовательскую работу.

#### **Основная литература:**

1. Колин К. Микроэконометрика. Книга 1 [Электронный ресурс] : методы и их применения / Э. Кэмерон Колин, Правин Триведи К. ; пер. С. Аванян [и др.]. — Электрон. текстовые данные. — М. : Дело, 2015. — 551 с. — 978-5-7749-0955-1. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/77351.html>