

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

К.М.02.02.03 Эконометрика

Авторы:

к.т.н., доцент Резниченко А. В.

к.э.н. доцент Жук И. А.

Код и наименование направления подготовки, профиля:

38.05.01 Экономическая безопасность

Специализация: Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Квалификация выпускника: экономист

Форма обучения: очная

Цель освоения дисциплины:

Сформировать компетенцию в области решения профессиональных задач в сфере экономической безопасности по средствам применения в своей профессиональной деятельности эконометрики. (УК ОС-2; ОПК-1; ОПК-2; ПК-2)

План курса:

Тема 1. Элементы математической статистики в Excel.

Числовые характеристики совокупности. Статистические оценки и их свойства. Ковариация. Проверка статистических гипотез. Пакет «Анализ данных» Excel. Примеры.

Тема 2. Основные понятия о эконометрике.

Общие понятия эконометрических моделей. Этапы эконометрического моделирования. Корреляция. Примеры.

Тема 3. Парная регрессия.

Парная регрессия. Метод наименьших квадратов (условия Гаусса-Маркова). Оценка качества уравнения парной регрессии. Прогнозирование с применением уравнения регрессии. Примеры.

Тема 4. Множественная регрессия.

Множественная регрессия (оценка параметров модели). Оценка качества модели множественной регрессии. Примеры.

Тема 5. Общие понятия гетероскедастичности

Общие понятия гетероскедастичности. Тесты для определения гетероскедастичности. Методы устранения(снижения) с гетероскедастичности. Примеры.

Тема 6. Мультиколлинеарность. Автокорреляция.

Понятие мультиколлинеарности. Понятие автокорреляции. Примеры.

Тема 7. Общие понятия о временных рядах

Общие понятия о временных рядах. Аддитивная модель временного ряда. Мультипликативная модель временного ряда. Примеры.

Тема 8. Системы одновременных уравнений.

Виды систем одновременных уравнений. Формы моделей.

Идентификация уравнений системы. Косвенный метод наименьших квадратов. Двухшаговый метод наименьших квадратов. Примеры.

Формы текущего контроля:

- при проведении занятий лекционного типа: опрос.
- при проведении практических занятий: опрос, решение задач, расчетно-графическая работа.
- при контроле результатов самостоятельной работы: контрольная работа

Формы промежуточной аттестации: расчетно-графическая работа

Основная литература:

1. Мардас, А. Н. Эконометрика : учебник и практикум для академического бакалавриата / А. Н. Мардас. — 2-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2019. — 180 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-8164-3. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/3802FBF4-01D0-4593-BB3C-550125E8BB6A.

2. Кремер, Н. Ш. Эконометрика : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; под ред. Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2019. — 308 с. — (Серия : Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-08710-9. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/6C571E05-1B51-450C-A1B7-34379B81722E.

3. Галочкин, В. Т. Эконометрика : учебник и практикум для бакалавриата и специалитета / В. Т. Галочкин. — М. : Издательство Юрайт, 2019. — 288 с. — (Серия : Бакалавр и специалист). — ISBN 978-5-534-10751-7. — Режим доступа : www.biblio-online.ru/book/0E81917E-A868-4C1C-941B-2E12932A788C.