

## АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Эконометрика»

по основной профессиональной образовательной программе по направлению подготовки  
38.03.01 «Экономика» (уровень бакалавриата)

**Направленность (профиль):** Цифровые финансы

**Общий объем дисциплины** – 4 з.е. (144 часов)

**Форма промежуточной аттестации** – Экзамен.

**В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы компетенции с соответствующими индикаторами их достижения:**

- ОПК-1.2: Решает прикладные задачи на основе положений экономической теории;
- ОПК-2.1: Способен выполнять обработку и статистический анализ данных;

**Содержание дисциплины:**

Дисциплина «Эконометрика» включает в себя следующие разделы:

**Форма обучения очная. Семестр 5.**

**1. Введение в эконометрику.** Эконометрика как результат взаимодействия и объединения трех компонент: : экономической теории, математики и статистики.

Эконометрические модели и их использование для обработки экономических данных. Спецификация модели. Оценка тесноты зависимости между переменными. Свойства коэффициента корреляции. Оценка значимости выборочного коэффициента корреляции. Мультиколлинеарность факторов. Классификация эконометрических моделей. Линейная регрессия. Фиктивные переменные..

**2. Предпосылки регрессионного анализа.** Условия Гаусса-Маркова. Проверка предпосылок построения классической линейной регрессионной модели: тест Голдфелда-Квандта, критерий Дарбина-Уотсона, первый коэффициент автокорреляции  $r(1)$ , R/S критерий..

**3. Прогнозирование с помощью линейной модели.** Точечный прогноз. Интервальная оценка. Расчет доверительных интервалов. Средние коэффициенты эластичности. Бета- коэффициенты (стандартизированные коэффициенты регрессии). Дельта- коэффициенты..

**4. Прогнозирование экономических процессов с использованием временных рядов.** Понятие и виды рядов динамики. Экстраполяция и интерполяция. Этапы построения прогноза по временным рядам .Оценка качества и точности построенных моделей. Построение точечных и интервальных прогнозов. Сезонные колебания..

**5. Системы эконометрических уравнений.** Классификация эконометрических систем. Условия идентификации эконометрических систем. Косвенный метод наименьших квадратов для построения эконометрических систем..

Разработал:  
доцент  
кафедры ПМ

М.А. Кайгородова

Проверил:  
Декан ФИТ

А.С. Авдеев