АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.О.08 Эконометрика

Наименование образовательной программы Финансы и кредит
Код и наименование направления подготовки 38.03.01 Экономика
Форма обучения: Очная

Планируемые результаты освоения дисциплины

Дисциплина Б1.О.08 «Эконометрика» обеспечивает овладение следующими компетенциями:

Код компетенции	**Наименование компетенции**	**Код этапа освоения компетенции**	**Наименование этапа освоения компетенции**
ОПК ОС-4	Способность применять эконометрические методы для решения прикладных задач.	ОПК ОС- 4.2	Способен применять современную методику построения эконометрических моделей; методы и приемы анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей

В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

ОТФ/ТФ *(при наличии проф-стандарта)*/ трудовые или профессиональные действия	Код компонента компетенции	Результаты обучения
-	ОПК ОС- 4.2 Способность применять инструменты эконометрики в целях сбора, обработки и анализа статистических данных	**на уровне знаний :** – представление о стандартных эконо-метрических моделях и способах их оценки
		на уровне умений : – использование специализированных программ для оценки параметров модели, – проверка адекватности модели, – оценивание параметров модели, – нахождение интервалов прогнозных значений
		на уровне навыков: – составление аналитических заключений для экономических и социально-экономических проектов или их прогнозов в части используемых показателей, характеризующих состояние и развитие анализируемой системы

Объем дисциплины

При реализации дисциплины Б1.О.08 «Эконометрика» отведено 8 ЗЕ, что составляет 288 ак.ч./216 астр.ч,:

- для очной формы обучения на контактную работу выделено 128акад. часов / 96 астр. час (из них: 64 акад. часов / 48 астр. час лекционных занятий, 64 акад. часов / 48 астр. час практических занятий (в том числе лабораторные работы 32 ак.ч./ 24 астр.ч.), 124 акад. часов / 93 астр. час – на самостоятельную работу, 36 акад. часов / 27 астр. час – на контроль (самостоятельная работа обучающихся в период зачетно-экзаменационной сессии).

Структура дисциплины

№ п/п	Наименование тем и/или разделов	Объем дисциплины (модуля), час.						Форма текущего контроля успеваемости*, промежуточной аттестации**
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СРО	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
5 семестр								
Раздел 1. Эконометрика: основные понятия и определения								
1.	Эконометрика и ее связь с экономической теорией. Методология эконометрического исследования. Типы экономических данных.	10	2	2		-	6	О
2.	Модель парной линейной регрессии. Метод наименьших квадратов. Теорема Гаусса-Маркова.	10	2	2		-	6	ОПЗ
Раздел 2. Регрессионные модели								
3.	Проверка гипотез в модели парной линейной регрессии. Выбор “наилучшей” модели. Нарушение предпосылок теоремы Гаусса-Маркова. Регрессия без свободного члена.	16	4	4		-	8	О, ИЗ 1
4.	Модель множественной линейной регрессии. МНК. Теорема Гаусса-Маркова. Проверка выполнения стандартных предположений об ошибках в линейной модели наблюдений.	22	6	6		-	10	О, ОПЗ
5.	Коэффициент детерминации и скорректированный коэффициент детерминации. Оценка качества модели множественной регрессии. Проверка гипотез в модели парной линейной регрессии. Выбор “наилучшей” модели.	22	6	4		-	12	ОПЗ
6.	Проверка гипотез и статистические выводы в модели множественной линейной регрессии.	20	4	4		-	12	ИЗ 2

7.	Нелинейные регрессионные модели.	22	4	4		-	14	О, ОПЗ
8.	Оценка исследований, основанных на множественной регрессии. Понятие о методе инструментальных переменных.	25	4	6		-	15	ОПЗ
	Промежуточная аттестация	**-**	-		-	**-**	**-**	**Зачет с оценкой**
	Итого (5 семестр)	**144/ 108**	**32/ 24**	**32/ 24**		**-**	**80/ 60**	**4 ЗЕТ**
6 семестр								
Раздел 3. Модели временных рядов								
9.	Стационарные временные ряды, Модели ARMA.	12	2		4	-	6	ОПЗ
10.	Нестационарные временные ряды. Различение стационарных и нестационарных рядов в рамках моделей ARIMA.	12	2		4	-	6	КР
11.	Регрессионный анализ для стационарных временных рядов. Динамические модели.	16	6		4	-	6	ОПЗ
12.	Регрессионный анализ нестационарных временных рядов. Коинтеграция и модели коррекции ошибок.	16	6		4	-	6	О, ОПЗ, Т
Раздел 4. Эконометрические методы в макроэкономическом анализе								
13.	Система линейных одновременных уравнений: понятие и проблемы идентификации.	14	4		4	-	6	ОПЗ
14.	Модели панельных данных	18	6		6	-	6	О, ОПЗ, Т
15.	Модели с ограниченной зависимой переменной	20	6		6	-	8	О, ОПЗ, Т
Промежуточная аттестация		**36/ 27**	-		-	**36/27**	**-**	**Экзамен**
Итого (6 семестр)		**144/ 108**	**32/ 24**		**32/ 24**	**-**	**44/ 33**	**4ЗЕТ**
Итого по дисциплине		**288/ 216**	**64/ 48**		**64/ 48**	**36/27**	**124/ 93**	**8 ЗЕТ**

Используемые сокращения:

Л – занятия лекционного типа (лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся);

ЛР – лабораторные работы (вид занятий семинарского типа);

ПЗ – практические занятия (виды занятий семинарского типа за исключением лабораторных работ);

КСР – индивидуальная работа обучающихся с педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях (в том числе индивидуальные консультации);

ДОТ – занятия, проводимые с применением дистанционных образовательных технологий, в том числе с применением виртуальных аналогов профессиональной деятельности;

СРО – самостоятельная работа, осуществляемая без участия педагогических работников организации и (или) лиц, привлекаемых организацией к реализации образовательных программ на иных условиях.

Примечание:

** формы текущего контроля успеваемости: опрос (О), индивидуальное задание (ИЗ); отчёт по практическим занятиям (ОПЗ), тестирование (Т)*

*** форма промежуточной аттестации: зачет с оценкой, экзамен*

Форма промежуточной аттестации:

Зачет с оценкой, экзамен.

Основная литература:

1. Сток Д., Уотсон М., 2015, Введение в эконометрику: Учебник. 3-е изд./ Пер с англ. – М.: Дело, 2015
2. Носко В.П. ЭконометрикаКнига 1, Ч.1,2: учебник. — М.: Дело, 2011. — 672 с.
3. Доугерти К. Введение в эконометрику: Учебник. 2-е изд./ Пер. с англ. – М.: ИНФРА-М, 2004. – 432 с.
4. Кэмерон Э.К. Микроэконометрика : методы и их применения: Книга 1 Учебное пособие / Кэмерон Э.К., Триведи П.К., пер. с англ. под науч. ред. Демешева Б. - М.:ИД Дело РАНХиГС, 2015. - 552 с.: 70x108 1/16. - (Академический учебник) (Переплёт) ISBN 978-5-7749-0955-1 - Режим доступа: https://new.znanium.com/catalog/product/982080
5. Кэмерон Э.К. Микроэконометрика : методы и их применения: Книга 2 Учебное пособие / Кэмерон Э.К., Триведи П.К., пер. с англ. под науч. ред. Демешева Б. - М.:ИД Дело РАНХиГС, 2015. - 664 с.: 70x108 1/16. - (Академический учебник) (Переплёт) ISBN 978-5-7749-0956-8 - Режим доступа: https://new.znanium.com/catalog/product/982081
6. Канторович Г.Г., Лекции: Анализ временных рядов, Экономический журнал ВШЭ, 2002, №№ 1-4, 2003, №1.