

Автор Лаптева Е.В., к.э.н., ст. преподаватель

Наименование дисциплины: Б1.Б.05 Эконометрика (продвинутый уровень)

Цель освоения дисциплины: продолжение углубленного изучения методологии эконометрического моделирования социально-экономических процессов и практическое овладение приемами количественного описания закономерностей развития экономики с использованием математико-статистического инструментария.

1. Требования к результатам освоения дисциплины:

| Индекс и содержание компетенции | Знания | Умения | Навыки и (или) опыт деятельности |
|--|--|--|--|
| ПК-3: способностью проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой | 1 этап: знать сущность экономических процессов и явлений 2 этап: знать понятие управленческого решения | 1 этап: применять современный математический инструментарий для решения содержательных экономических задач 2 этап: выбирать необходимый эконометрический инструментарий | 1 этап: навык работы с периодической, научной литературой 2 этап: навык работы с информационной литературой |
| ПК-9: способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов | 1 этап: знать основы эконометрического моделирования 2 этап: знать современные методы эконометрического анализа | 1 этап: формировать прогнозы развития конкретных экономических процессов на макро-, микро- и мезоуровне 2 этап: интерпретировать полученные результаты | 1 этап: навык обоснования методики расчетов 2 этап: прогнозирование по эконометрической модели |
| ПК-12: способностью разрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально- | 1 этап: знать современные программные продукты, необходимые для решения экономико- | 1 этап: использовать современное программное обеспечение для решения экономико- | 1 этап: эконометрической терминологией 2 этап: самостоятельно строить |

| | | | |
|--------------------------------|--|--|----------------------------|
| экономической эффективности | статистических задач 2 этап: знать методику эконометрическ ого моделирования | статистических и эконометрических задач 2 этап: прогнозировать и принимать управленческие решения | эконометрические модели |
|--------------------------------|--|--|----------------------------|

2. Содержание дисциплины:

Раздел 1 Эконометрические модели и проблемы эконометрического моделирования

Тема 1 Основные аспекты построения эконометрических моделей

Тема 2 Основные проблемы эконометрического моделирования.

Раздел 2 Регрессионные модели социальных и экономических процессов

Тема 3 Построение линейной и нелинейных моделей регрессии. Оценка их адекватности.

Тема 4 Точечный и интервальный прогноз по моделям регрессии.

Раздел 3 Эконометрическое моделирование и прогнозирование временных рядов

Тема 5 Моделирование одномерных временных рядов

Тема 6 Моделирование взаимосвязанных временных рядов.

Раздел 4 Эконометрические модели из линейных уравнений

Тема 7 Проблемы идентификации эконометрических моделей из линейных уравнений.

Тема 8 Методы оценивания эконометрических моделей из линейных уравнений.

3. Общая трудоёмкость дисциплины: 3 ЗЕ.