

# АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

## Эконометрика

### 38.04.01- Экономика, программа «Экономика фирмы»

---

2

(семестр)

#### **1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

Целями освоения дисциплины «Эконометрика» являются: обучение построению эконометрических моделей; оценке качества моделей; прогнозированию социально-экономических процессов с использованием эконометрических моделей.

#### **2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО**

Дисциплина «Эконометрика» относится к дисциплинам базовой части. Изучение дисциплины обеспечивает формирование у студентов навыков работы с методами решения сложных задач, необходимых в дальнейшей профессиональной деятельности.

Логически дисциплина увязана с такими основными базовыми курсами как: «Микроэкономика», «Экономика фирмы» и др. Знания, полученные в рамках изучения дисциплины, могут быть применены при прохождении практик, выполнении научно-исследовательских работ, написании выпускной квалификационной работы (магистерской диссертации).

#### **3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ**

- способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов (ПК-9);
- способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом (ПК-10).

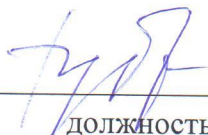
#### **4. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

1. Предмет эконометрики. Методология эконометрического исследования.
2. Основные понятия теории вероятностей.
3. Нормальное распределение и связанные с ним Хи-квадрат распределение, t-распределение и F-распределение.
4. Выборка и статистическое оценивание.
5. Проверка статистических гипотез.
6. Линейная регрессионная модель для случая одной объясняющей переменной.
7. Метод наименьших квадратов (МНК).
8. Дисперсионный анализ.
9. Теорема Гаусса-Маркова.


10. Предположение о нормальном распределении случайной ошибки в рамках классической линейной регрессии и его следствия.
11. Множественная линейная регрессия.
12. Функциональные преобразования переменных в линейной регрессионной модели.
13. Фиктивные (dummy) переменные.
14. Мультиколлинеарность.
15. Гетероскедастичность.
16. Автокорреляция случайной составляющей.
17. Выбор "наилучшей" модели. Ошибка спецификации модели.
18. Оценивание одновременных уравнений.
19. Модели временных рядов, оценка точности и адекватности моделей тренда.
20. Авторегрессионная модель и модель с распределенными лагами.

**5. ВИД АТТЕСТАЦИИ - экзамен**  
 экзамен, зачет, зачет с оценкой

**6. КОЛИЧЕСТВО ЗАЧЕТНЫХ ЕДИНИЦ – 2 з.е.**

Составитель:  к.э.н., доцент каф. БИЭ А.М. Губернаторов  
 должность, ФИО, подпись

Заведующий кафедрой ЭУИИ  И.Б. Тесленко  
 ФИО, подпись

Председатель  
 учебно-методической комиссии  
 направления (специальности)  П.Н. Захаров  
 ФИО, подпись

Директор ИЭиМ  П.Н. Захаров  
 ФИО, подпись

Дата: 29.04.2015



Печать института