

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ «Эконометрика»

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

Направленность (профиль): Финансы и кредит

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. Понятие эконометрики.. Понятие эконометрики, ее цели и задачи. Случайная величина (СВ) и ее характеристики. Взаимосвязь СВ. Ковариация, коэффициент корреляции. Их свойства. Законы распределения СВ. Выборочные характеристики. Точечные оценки и их свойства. Интервальные оценки. Оценка значимости коэффициента корреляции. Прикладные задачи экономике на основе положений экономической теории.

2. Основные положения теории вероятностей и математической статистики.. Статистический анализ данных. Парная регрессия. Постановка задачи. Метод наименьших квадратов (МНК). Предпосылки МНК. Оценка значимости коэффициентов уравнения. Автокорреляция остатков. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация..

3. Линейная модель множественной регрессии. Классическая линейная модель множественной регрессии (КЛММР). МНК для КЛММР. Предпосылки МНК. Парная и частная корреляция в КЛММР, множественный коэффициент корреляции, коэффициент детерминации. Значимость коэффициентов уравнения

Линейная модель множественной регрессии с гетероскедастичными остатками. Обнаружение гетероскедастичности: графический метод, тесты Спирмена, Голдфелда-Квандта, Бартлетта. Метод взвешенных наименьших квадратов..

Разработал:

доцент

кафедры ЭиУ

Г.А. Обухова

Проверил:

Декан ТФ

А.В. Сорокин