

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Суворов Антон Дмитриевич  
Должность: Ректор  
Дата подписания: 27.09.2023 13:13:33  
Уникальный программный ключ:  
a39bdb15d680d3b0adbfced0af5c1efb14747dc0

**УТВЕРЖДАЮ**  
Ректор А.Д. Суворов  
«3» июля 2023 г.

Протокол Совета программы  
«Магистр экономики»  
№ 70 от 29 июня 2023 г.

## **Аннотация рабочей программы дисциплины**

### **Эконометрика-2**

#### **Направление подготовки 38.04.01 Экономика**

#### **Программа «Магистр экономики»**

#### **1. Цели и задачи дисциплины**

Цель курса - ознакомление студентов с эконометрикой временных рядов, автокорреляцией, гетероскедастичностью, панельными данными, моделями с ограниченной зависимой переменной и единичным корнем. Задача курса - научить студентов использовать полученные знания для использования в практической деятельности, связанной с анализом реальных экономических явлений и процессов.

#### **2. Планируемые результаты**

В результате освоения дисциплины выпускник должен:

**знать** основополагающую концепцию эконометрического анализа сложных экономических явлений; основные методологические подходы и принципы применения аппарата эконометрического моделирования в прикладных исследованиях; базовые типы эконометрических моделей; статистические методы оценивания параметров эконометрической моделей; технологию статистической проверки различных гипотез; приемы интерпретации результатов эконометрического моделирования.

**уметь** корректно осуществлять спецификацию эконометрических моделей; пользоваться компьютерным программным обеспечением для расчета оценок параметров эконометрических моделей; проверять адекватность построенных моделей и значимость их параметров; интерпретировать содержательный смысл параметров регрессионных моделей; применять эконометрические модели в практике экономического анализа; осуществлять прогнозные расчеты с помощью построенных эконометрических моделей.

**владеть** методикой проверки согласованности дедуктивных моделей с результатами эмпирических исследований; аппаратом и техникой эконометрического моделирования

социально-экономических процессов; навыками проведения сложных компьютерных расчетов с использованием эконометрических моделей.

### 3. Компетенции, формируемые дисциплиной

Дисциплина направлена на формирование универсальных компетенций:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
УК-1. Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий	Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий
УК-3. Способен организовывать и руководить работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели	Принимает участие в организации и руководстве работой команды, вырабатывая командную стратегию для достижения поставленной цели

Дисциплина направлена на формирование общепрофессиональных компетенций:

Код и наименование компетенции выпускника	Индикаторы достижения компетенций
ОПК-1. Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач	Применяет знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач
ОПК-3. Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике	Обобщает и критически оценивает научные исследования в экономике

Дисциплина направлена на формирование профессиональных компетенций:

Код и наименование компетенции	Индикаторы достижения компетенций
ПК-1. Способен осуществлять деятельность по разработке и совершенствованию прикладных статистических методологий	Участвует в разработке и совершенствовании методологии сбора и обработки статистических данных
	Участвует в разработке и совершенствовании систем статистических показателей и методик их расчета
	Участвует в проектировании новых форм статистической отчетности, вопросников и анкет, подготовке инструкций по их заполнению

### 4. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Эконометрика-2» является обязательной дисциплиной вариативной части Блока 1 учебного плана программы «Магистр экономики».

Трудоёмкость дисциплины составляет 3 зачётные единицы. Общий объём академических часов – 108 часов, в том числе:

Лекции – 28 часов.

Семинары – 14 часов.

## **5. Содержание дисциплины**

Введение. Базовый регрессионный анализ с данными временных рядов.

Проблемы с дальнейшим использованием обычного метода наименьших квадратов для данных временных рядов.

Автокорреляция и неоднородность дисперсии в регрессиях временных рядов.

Простые методы данных многомерного временного ряда.

Продвинутое методы данных многомерного временного ряда.

Модели ограниченной зависимой переменной и проведение выборки.

Продвинутое темы, связанные с временными рядами.

## **6. Форма промежуточной аттестации**

Промежуточная аттестация проходит в форме экзамена.