

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-3

Направление подготовки 38.04.01 Экономика

Программа «Магистр экономики»

1. Цели и задачи дисциплины

Цель курса – ознакомление студентов с важнейшими эконометрическими понятиями и инструментами высокого уровня сложности. Курс посвящен различным типам эконометрических регрессионных моделей, уделяя важное внимание их практическим приложениям. Задача курса - дать студентам объяснение того, почему определенные эконометрические методы работают, а также снабдить их базой, необходимой для разработки новых методов.

2. Планируемые результаты

В результате освоения дисциплины выпускник должен:

знать основные методологические подходы и принципы применения аппарата эконометрического моделирования в прикладных исследованиях; базовые типы эконометрических моделей; современные эконометрические методы, используемые для оценивания динамических экономических моделей, их статистического анализа и экономического прогнозирования; преимущества и недостатки этих методов; базовые понятия эконометрики временных рядов.

уметь интерпретировать содержательный смысл параметров регрессионных моделей; применять эконометрические модели в практике экономического анализа; осуществлять прогнозные расчеты с помощью построенных эконометрических моделей; проверять адекватность построенных моделей и значимость их параметров; осуществлять выбор инструментальных средств для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы.

владеть современной методикой построения эконометрических моделей; методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью одномерных и многомерных моделей; современными методиками расчета и статистического анализа экономических показателей, характеризующих экономические процессы и явления на микроуровне и макроуровне; 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, выработать стратегию действий	Осуществляет критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий
УК-3. Способен организовывать и руководить работой команды, выработывая командную стратегию для достижения поставленной цели	Принимает участие в организации и руководстве работой команды, выработывая командную стратегию для достижения поставленной цели

Дисциплина направлена на формирование общепрофессиональных компетенций:

Код и наименование компетенции	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
ОПК-5. Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	Использует современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач

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-3»* 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

Условное распределение и условное ожидание. Виды регрессий. Линейная проекция. Случайная и неслучайная выборка.

Параметрическое, непараметрическое и полупараметрическое оценивание. Асимптотическая теория. Инструменты для построения асимптотик.

Асимптотические доверительные интервалы. Асимптотика временных рядов.

Линейная средняя регрессия. Линейная средняя регрессия временных рядов.

Нелинейная средняя регрессия. Модель бинарного выбора

Непараметрическая средняя регрессия. Дискретные средние регрессоры. Непрерывные регрессоры. Многофакторная ядерная регрессия.

6. Форма промежуточной аттестации

Промежуточная аттестация проходит в форме экзамена.