

Аннотация к рабочей программе дисциплины «Эконометрика»

Цель преподавания дисциплины - формирование у магистрантов целостного представления об основных законах эконометрики, ее принципах и методах, современных методах и моделях эконометрических исследований.

Задачи изучения дисциплины

- изучить основные законы эконометрики;
- сформировать представление о современных тенденциях эконометрики;
- развить навыки применения эконометрических моделей при анализе конкретных объектов хозяйствования на микро- и макроуровне;
- научиться решать проблему выбора лучшей модели;
- изучить методы автоматической классификации и кластерный анализ;
- развить навыки самостоятельного анализа актуальных социальных проблем российского общества и адекватной оценки проводимых в стране преобразований.

Компетенции, формируемые в результате освоения дисциплины

ОК-1 способностью к абстрактному мышлению, анализу, синтезу

ОПК-3 способностью принимать организационно-управленческие решения

ПК-2 способностью обосновывать актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной темы научного исследования

ПК-4 способностью представлять результаты проведенного исследования научному сообществу в виде статьи или доклада

ПК-6 способностью оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности

ПК-9 способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов

ПК-12 способностью обрабатывать варианты управленческих решений и обосновывать их выбор на основе критериев социально-экономической эффективности

ПК-13 способностью применять современные методы в методике преподавания экономических дисциплин в профессиональных образовательных организациях, образовательных организациях высшего образования, дополнительного профессионального образования

Разделы дисциплины

1 Эконометрические модели с нарушением условий классической модели
2 Обобщенный МНК (ОМНК) в условиях гетероскедастичности
3 Модели с автокорреляцией остатков.

4	Методы выявления и устранения автокорреляции ОМНК при наличии автокорреляции в остатках.
5	Графические методы исследования ряда остатков. Методы проверки нормального распределения в ряду остатков
6	Современные подходы и требования к выбору, построению и исследованию регрессионных моделей. Проблема выбора лучшей модели. Нелинейные регрессионные модели.
7	Линеаризация. Тест Бокса –Кокса. Преобразование Зарембки. Системы одновременных эконометрических уравнений.
8	Косвенный, двухшаговый и трехшаговый МНК Методы автоматической классификации. Кластерный анализ. Применение эконометрических моделей в микро и макроэкономическом анализе