

Аннотация учебной дисциплины «ЭКОНОМЕТРИКА»

**для образовательной программы «Фондовый рынок и инвестиции»
направление 38.03.01 Экономика подготовки бакалавра**

Цели освоения дисциплины

Дать студентам научное представление о методах и моделях современной эконометрики, которые позволяют давать количественную оценку основным закономерностям экономической теории.

Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины

В результате освоения дисциплины студент должен:

- **Знать:** основные понятия эконометрики, основные методы оценивания неизвестных параметров эконометрических моделей, методы проверки статистических гипотез о параметрах построенных моделей, основные методы диагностики (проверки качества) эконометрических моделей.
- **Уметь:** применять стандартные методы построения эконометрических моделей, обрабатывать статистическую информацию и получать статистически обоснованные выводы, давать содержательную интерпретацию результатов эконометрического моделирования.
- **Иметь навыки** (приобрести опыт): обработки реальных статистических данных; применения эконометрических пакетов для построения и диагностики эконометрических моделей (например, ППП MS Excel, Eviews, STATA, Gretl, R).

Тематическое содержание учебной дисциплины

Тема 1. Основные понятия эконометрики. Парная линейная регрессия

Тема 2. Множественная линейная регрессия. Теорема Гаусса-Маркова

Тема 3. Некоторые аспекты множественной линейной регрессии: проверка гипотезы о наличии линейных ограничений на параметры; введение в модель *dumtmy*-переменных; тест Чоу

Тема 4. Нарушения предпосылок теоремы Гаусса-Маркова: ошибки спецификации; мультиколлинеарность; гетероскедастичность; автокорреляция

Тема 5. Прогнозирование в регрессионных моделях

Учебно-методическая литература

- **Базовый учебник**

Доугерти К. Введение в эконометрику. Учебник. 3-е изд. – М.: ИНФРА-М

- **Основная литература:**

1. Maddala G. S. Introduction to econometrics. 3-rd ed. John Wiley & Sons
2. Вербик М. Путеводитель по современной эконометрике. М.: Научная книга (исходные данные для решения некоторых задач размещены на сайте: <http://www.econ.kuleuven.ac.be/GME/>).

- **Дополнительная литература:**

1. Берндт Э.Р. Практика эконометрики. Классика и современность. М.: Юнити
2. Катышев П.К., Магнус Я.Р., Пересецкий А.А., Головань С.В. Сборник задач к начальному курсу эконометрики. Учебное пособие. – 4-е изд. М.: Дело, (исходные данные для решения задач размещены на сайте курса: <http://econometrics.nes.ru/mkp/>)
3. Магнус Я.Р., Катышев П.К., Пересецкий А.А. Эконометрика. Начальный курс: Учебник. – 8-е изд. – М.: Дело
4. Greene W.H. Econometric analysis. 5-th ed. New York University
5. Gujarati D.N. Basic Econometrics. 4-th ed. McGraw-Hill
6. Pindyck R.S., Rubinfeld D.L. Econometric models and economic forecasts. 3-rd ed. McGraw-Hill