

# **АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

## **«Эконометрика»**

### **1. Место дисциплины в структуре ОПОП.**

Дисциплина «Эконометрика» относится к дисциплинам Блока 1 базовой части Б1.Б.03. основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки 38.04.01 Экономика, программы магистратуры «Налоги. Бухгалтерский учет. Налоговый консалтинг»

### **2. Объем дисциплины: 5 зачетных единиц**

**3. Содержание дисциплины:** Линейная модель множественной регрессии. Теорема Гаусса-Маркова. Оценка значимости уравнения дисперсии (коэффициенты корреляции и детерминации). Проверка гипотез (критерий Фишера). Доверительные интервалы и доверительные области. Мультиколлинеарность и методы борьбы с ней. Линейные регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные). Линейные регрессионные модели с автокоррелированными ошибками. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация. Стационарные временные ряды и их характеристики. Автокорреляционная функция. Аналитическое сглаживание временного ряда. Модели скользящего среднего и авторегрессионные модели. Системы одновременных уравнений Косвенный метод наименьших квадратов Двухшаговый метод наименьших квадратов. Работа с панельными данными.

### **4. Планируемые результаты обучения по дисциплине.**

В результате освоения дисциплины у студента должны быть сформированы следующие компетенции:

- способностью к абстрактному мышлению, анализу, синтезу (ОК-1);
- способностью принимать организационно-управленческие решения (ОПК-3);
- способностью самостоятельно осуществлять подготовку заданий и разрабатывать проектные решения с учетом фактора неопределенности, разрабатывать соответствующие методические и нормативные документы, а также предложения и мероприятия по реализации разработанных проектов и программ (ПК-5);
- способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов (ПК-9).

### **5. Форма контроля: экзамен.**

### **6. Разработчик: Тотиева Ж.Д., к.ф.-м.н., доцент кафедры алгебры и анализа**