

**МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**  
**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ**  
**УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**  
**«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»**

СОГЛАСОВАНО:

Выпускающая кафедра ФК  
Заведующий кафедрой ФК

15 мая 2019 г.

З.П. Межох

УТВЕРЖДАЮ:

Директор ИЭФ

23 мая 2019 г.

Ю.И. Соколов

Кафедра «Информационные системы цифровой экономики»

Автор Ишханян Маргарита Владимировна, к.ф.-м.н., доцент

**АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ**

**«Эконометрика»**



Направление подготовки: 38.03.01 – Экономика

Профиль: Финансы и кредит

Квалификация выпускника: Бакалавр

Форма обучения: очно-заочная

Год начала подготовки: 2018

<p style="text-align: center;">Одобрено на заседании Учебно-методической комиссии института Протокол № 7 20 мая 2019 г. Председатель учебно-методической комиссии</p> <p style="text-align: right;"> М.В. Ишханян</p>	<p style="text-align: center;">Одобрено на заседании кафедры</p> <p style="text-align: center;">Протокол № 14 15 мая 2019 г. Заведующий кафедрой</p> <p style="text-align: right;"> Л.А. Каргина</p>
--	--

## 1. Цели освоения учебной дисциплины

Целями освоения учебной дисциплины (модуля) «Эконометрика» являются дать студентам основы теоретических знаний и прикладных навыков применения эконометрических методов и моделей, подготовить к использованию этих методов для разработки и принятия эффективных организационных и управленческих решений, развить аналитическое мышление и повысить общий уровень математической культуры.

## 2. Место учебной дисциплины в структуре ОП ВО

Учебная дисциплина "Эконометрика" относится к блоку 1 "Дисциплины (модули)" и входит в его базовую часть.

## 3. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

ОПК-1	способностью решать стандартные задачи профессиональной деятельности на основе информационной и библиографической культуры с применением информационно-коммуникационных технологий и с учетом основных требований информационной безопасности
ПК-4	способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты

## 4. Общая трудоемкость дисциплины составляет

6 зачетных единиц (216 ак. ч.).

## 5. Образовательные технологии

Преподавание дисциплины осуществляется в форме лекционных и практических занятий. Лекции проводятся в традиционной классно-урочной организационной форме, по типу управления познавательной деятельности являются классическо-лекционными (объяснительно-иллюстративными). Практические занятия организованы с использованием технологий развивающего обучения. Практический курс выполняется в виде традиционных практических занятий (объяснительно-иллюстративное решение задач), с использованием интерактивных (диалоговые) технологий, в том числе разбор и анализ конкретных ситуаций, электронный практикум (компьютерное моделирование и практический анализ результатов); технологий, основанных на коллективных способах обучения, а также с использованием компьютерной тестирующей системы. Самостоятельная работа студента организована с использованием традиционных видов работы и интерактивных технологий. К традиционным видам работы относятся отработка учебного материала и отработка отдельных тем по учебным пособиям, подготовка к промежуточным контролям, выполнение заданий курсовой работы. К интерактивным (диалоговым) технологиям относятся отработка отдельных тем по электронным пособиям, подготовка к промежуточным контролям в интерактивном режиме, интерактивные консультации в режиме реального времени по специальным разделам и технологиям, основанным на коллективных способах самостоятельной работы студентов. Оценка полученных знаний, умений и навыков основана на модульно-рейтинговой технологии. Весь курс разбит на разделы, представляющих собой логически завершенный объем учебной информации. Фонды оценочных средств освоенных

компетенций включают как вопросы теоретического характера для оценки знаний, так и задания практического содержания (решение практических и ситуационных задач, выполнение заданий курсовой работы) для оценки умений и навыков. Теоретические знания проверяются путём применения таких организационных форм, как индивидуальные и групповые опросы, решение тестов с использованием компьютеров или на бумажных носителях..

## **6. Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам)**

### **РАЗДЕЛ 1**

Введение в эконометрику

Тема: Основные понятия эконометрики. Виды эконометрических моделей и типов данных. Основные этапы эконометрического моделирования.

Тема: Способы представления и обработки статистических данных.

Тема: Статистические выводы: оценки и проверки гипотез

### **РАЗДЕЛ 2**

Парный корреляционный анализ.

Тема: Парная корреляция. Коэффициент парной корреляции: свойства, шкала Чеддока.

Тема: Оценка статистической значимости коэффициента парной корреляции.  
Интервальная оценка

### **РАЗДЕЛ 3**

Парный регрессионный анализ.

Тема: Модель парной линейной регрессии. Оценка параметров модели методом наименьших квадратов. Теорема Гаусса—Маркова.

Тема: Оценка качества модели.

Тема: Интервальные оценки коэффициентов парного линейного уравнения регрессии.

Тема: Точечный и интервальный прогноз.

Тема: Нелинейные модели парной регрессии

Тема: Эластичность.

### **РАЗДЕЛ 4**

Множественный корреляционный анализ.

Тема: Множественная и частная корреляция: статистическая значимость, оценка тесноты корреляционной связи.

### **РАЗДЕЛ 5**

Множественный регрессионный анализ.

Тема: Классическая модель множественной линейной регрессии (КММЛР). Требования КММЛР. Теорема Гаусса-Маркова. Оценка параметров КММЛР методом наименьших квадратов.

Тема: Оценка тесноты множественной линейной регрессионно-корреляционной связи

Тема: Оценка качества уравнения множественной линейной регрессии

Тема: Проверка выполнения требований КММЛР. Автокорреляция в остатках. Критерий Дарбина-Уотсона. Анализ остатков. Понятие гетероскедастичности.

Тема: Приложения регрессионной модели: построение прогнозов, частные уравнения регрессии, средний и частные коэффициенты эластичности

## РАЗДЕЛ 6

Некоторые вопросы практического использования регрессионных моделей.

Тема: Отбор факторов в регрессионную модель. Понятие интеркорреляции и мультиколлинеарности

Тема: Фиктивные переменные.

Тема: Критерий Грегори Чоу.

## РАЗДЕЛ 7

Временные ряды.

Тема: Моделирование временного ряда. Понятие одномерного временного ряда. Графическая иллюстрация. Стационарные и динамические ряды. Критерии о наличии тенденции ряда

Тема: Исследование структуры ряда. Автокорреляция уровней ряда

Тема: Моделирование сезонных и циклических колебаний. Модели временных рядов с учетом сезонности. Оценка качества модели.

Тема: Построение прогнозов на основе различных моделей временных рядов.

Тема: Численное и аналитическое сглаживание временного ряда.

Тема: Модель временного ряда без учета сезонности. Оценка качества модели.

## РАЗДЕЛ 8

Курсовая работа

Экзамен