Рабочая программа дисциплины
«Эконометрика – 2,3»

Направление подготовки 38.04.01 Экономика (уровень магистратуры)
для подготовки студентов – магистров очного отделения

Автор - составитель программы: д.ф-м.н., профессор С.А.Айвазян

1. Цели и задачи дисциплины:

А. Цели дисциплины

Студенты должны получить знания и умения, необходимые для решения задач выявления и модельного описания связей, существующих между различными рядами динамических показателей экономической, социально-экономической и финансовой природы. Изучение курса «Эконометрика-3» предназначено для формирования и усвоения знаний, умений, навыков в области экономической теории и практики, которые необходимы для работы в государственных и частных структурах, а также развития профессиональных качеств, компетенций, необходимых для выполнения функциональных обязанностей в сфере экономики.

Б. Задачи дисциплины

ознакомление студентов с основами теории и методологии использования методов многомерного статистического анализа (МСА) в эконометрическом моделировании,

раскрытие роли методов МСА в реалистическом моделировании механизмов социально-экономических процессов,

привитие практических навыков эконометрического моделирования с использованием методов МСА,

формирование общего представления о роли и месте методов МСА в эконометрическом моделировании

2. Информация о месте дисциплины в учебном плане:

— первый курс;
— первый и второй семестры;

3. Форма промежуточной аттестации (первый семестр – экзамен; второй семестр - экзамен);

4. Объем дисциплины:

Курс объемом в 114 часов предусматривает следующие формы проведения занятий:

Лекции 44 ч., семинарские занятия 34 ч., самостоятельная работа 102 ч.

5. Тематический план:

№ п/п	Наименование разделов и тем дисциплины
	***Первый* семестр**
1	***Содержание и назначение прикладного МСА***
2	***Способы описания поведения многомерного признака***
3	***Классификация многомерных наблюдений и статистические методы распознавания образов***
4	***Снижение размерности исследуемого признакового пространства и отбор наиболее информативных показателей***
	Второй семестр
5	***Введение в теорию систем одновременных уравнений***
6	***Условия идентифицируемости СОУ***
7	***Методы идентификации СОУ***
8	***Анализ конкретных моделей СОУ***
9	***Анализ точности модели, построенной в форме СОУ, и прогноз эндогенных переменных***

10	*Разбор типовых задач на построение и анализ СОУ*

6. Перечень компетенций, формируемых в результате освоения дисциплины

Общекультурные компетенции:

Общенаучные

Владеть методологией научного исследования общественных явлений и процессов (М-ОНК-3)

Инструментальные

владение современными методами и инструментами исследования социально- экономических процессов, сравнительного анализа национальных моделей экономики (М- ИК-2);

Системные

Способность к анализу экономических процессов в стране и современном мире (М-СК-4);
Способность к поиску, критическому анализу, обобщению и систематизации научной информации, к постановке целей исследования и выбору оптимальных путей и методов их достижения (М-СК-2);

Профессиональные

способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов (М-ПК-8);
способность проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой, уметь осуществлять профессиональную самооценку (М-ПК-3).

7. Основная литература:

1) Айвазян С.А. Прикладная статистика и основы эконометрики. Том 2: Основы эконометрики Москва: Юнити, 2001
2) Магнус Я.Р., Катышев А.К., Пересецкий А.А. Эконометрика. Начальный курс. 7-е издание. Москва: Дело, 2005
3) Айвазян С.А. Методы эконометрики Москва: Магистр, 2010