Подвальный Евгений Семенович
Подписано цифровой подписью: Подвальный Евгений Семенович
Дата: 2025.03.25 11:27:50 +03'00'

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.11 «Эконометрические вычисления в менеджменте»

Наименование образовательной программы: программа бакалавриата «Организационный менеджмент»

Код и наименование направления подготовки 38.03.02 «Менеджмент»

Форма обучения очная

Сформировать компетенции:
ПКс-7 «Способен выявлять факторы влияющие на бухгалтерскую отчетность и оценивать достоверность бухгалтерской отчетности по оказанию услуг в области бухгалтерского учета»

Объем дисциплины: 72/2

Структура дисциплины:

№ п/п	Наименование тем	Краткое описание тем
1.	Основные понятия и структура дисциплины «Эконометрические вычисления в менеджменте». Эконометрическое моделирование	Основные виды эконометрических моделей и их классификация. Построение эконометрических моделей: основные этапы и их описание. Типы экономических данных, используемые при проведении эконометрических исследований: пространственные данные и временные ряды. Особенности специфики экономических данных.
2.	Парная корреляция и регрессия. Корреляционно-регрессионный анализ	Средние величины. Функциональная и статистическая связь. Модель регрессии. Корреляционная зависимость. Модельное уравнение регрессии. Корреляционно-регрессионный метод и условия его применения. Парная корреляция и регрессия в эконометрических исследованиях. Метод наименьших квадратов (МНК), условия его применения. Примеры нелинейных регрессионных зависимостей. Нелинейный МНК. Методы линеаризации.
3.	Множественная корреляция и регрессия	Основы множественного регрессионного анализа. Особенности спецификации модели. Матрица показателей корреляции. Мультиколлинеарность факторов и методы их устранения. Предпосылки МНК. Оценка характеристик силы связи (несмещенность, эффективность и состоятельность). Автокорреляция остатков. Обобщенный МНК. Критерии адекватности эконометрической модели. Зависимость ошибок модели и ковариационная матрица ошибок.
4.	Особенности анализа временных рядов	Ряды динамики. Временные ряды и их классификация. Понятие об основной тенденции и колеблемости временных рядов. Экстраполяционные методы и модели прогнозирования социально-экономических процессов. Методы преобразования наблюдаемого ряда к стационарному процессу. Тесты на стационарность и их классификация. Модели авторегрессии, скользящего среднего.
5.	Корреляция временных рядов	Корреляция между временными рядами: сущность ограничения. Проблема ложной корреляции. Методы

№ п/п	Наименование тем	Краткое описание тем
		измерения корреляции между колебаниями признаков. Корреляция с учетом лага и циклов. Корреляция отклонений от тренда с лагом, известным заранее. Корреляция отклонений от тренда с неизвестным заранее лагом. Понятие о динамике комплекса статистически взаимосвязанных признаков.
6.	Системы эконометрических уравнений	Системы независимых уравнений и их применений в микро- и макро- экономических исследованиях. Системы рекурсивных и взаимозависимых уравнений (совместных, одновременных уравнений). Структурная и приведенная форма модели. Эндогенные и экзогенные переменные. Методы оценивания коэффициентов структурной модели. Косвенный, двух-шаговый, трех-шаговый метод наименьших квадратов. Применение систем эконометрических уравнений.

Форма промежуточной аттестации – зачет с оценкой
При проведении зачета с оценкой с использованием дистанционных образовательных технологий промежуточная аттестация проводится в форме тестирования.

Основная литература:

1. Кремер Н.Ш. Математика для экономистов от арифметики до эконометрики: учебно-справочное пособие. - 3е изд. перераб. и доп. - М.: Юрайт, 2012. - 685 с.
2. Попов А.М., Сотников В.Н. Экономико-математические методы и модели. Учебник для прикладного бакалавриата. - М.: Юрайт, 2016. - изд. 3-е. - 345 с.
3. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры/ Под. ред. И.И. Елисеевой. - М.: Юрайт, 2015. - 449 с.