АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ОД.7 Анализ временных рядов и прогнозирование

по направлению подготовки: 38.03.01 «Экономика»
по профилю «Бизнес-статистика и прогнозирование»
Квалификация выпускника: БАКАЛАВР
Выпускающая кафедра: БСМЭ

Кафедра-разработчик рабочей программы: «Бизнес-статистики и математических методов в экономике»

1. Цели освоения дисциплины

Целями освоения дисциплины «Анализ временных рядов и прогнозирование» являются:
а) формирование знаний о методологии статистического анализа состояния и перспектив развития экономических явлений и процессов;
б) обучение методике построения адекватных, и в достаточной степени аппроксимирующих реальные явления и процессы прогностических моделей;
в) обучение способам применения вычислительной техники, прикладных программ, математических и статистических методов при решении эконометрических задач;
г) раскрытие сущности процессов, лежащих в основе использования определенных эконометрических моделей прогнозирования.

2. Содержание дисциплины:

Структура временного ряда
Моделирование временного ряда
Изучение взаимодействия двух временных рядов
Критерий Гольдфельда-Квандта
Критерий Дарбина-Уотсона
Адаптивные методы прогнозирования
Модели авторегрессии – скользящего среднего

3. В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

1) Знать:
а) существующие статистико-математические методы и модели, применяемые при анализе, расчете и прогнозировании показателей, представленных временными рядами;
б) методику сбора и анализа статистической информации, необходимой для разработки экономико-статистических моделей;
2) Уметь:
а) применять аппарат эконометрического моделирования в прикладных исследованиях;
б) анализировать и прогнозировать с использованием экономико-статистических моделей конкретные социально-экономические явления и процессы.
3) Владеть:
а) инструментом «Анализ данных» ППП MS Excel для осуществления эконометрических расчетов;
б) одним из специализированных программных пакетов для статистической обработки информации.

Зав.каф. БСМЭ Аксянова А.В.