

АННОТАЦИЯ РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.07

Анализ временных рядов и прогнозирование

по направлению подготовки: 01.03.05 «Статистика»

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.