



Основная профессиональная образовательная программа
38.04.01 Экономика
(Экономика фирмы и отраслевых рынков)


Министерство науки и высшего образования Российской Федерации

ИВАНОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Кафедра экономического анализа и бухгалтерского учета

ОДОБРЕНО:

Руководитель ОП

 Ибрагимова Р.С.
(подпись)

« 13 » июне 20 18 г.

Рабочая программа дисциплины

Эконометрика

Уровень высшего образования:	магистратура
Квалификация выпускника:	магистр
Направление подготовки:	38.04.01 Экономика
Направленность (профиль) образовательной программы:	Экономика фирмы и отраслевых рынков
Тип образовательной программы:	программа академической магистратуры

Иваново



1. Цели освоения дисциплины

Цель дисциплины — дать магистрантам современные теоретические знания и практические навыки в области спецификации, оценивания и проверки адекватности регрессионных моделей финансово-экономических объектов, достаточные для изучения всех специальных и прикладных дисциплин учебных программ, а также проведения собственных научных исследований в финансово-экономической сфере.

2. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина относится к базовым дисциплинам (Б1.Б.03). Для ее освоения необходимыми представляются знания, полученные по дисциплинам «Микроэкономика» и «Макроэкономика», «Математический анализ», «Линейная алгебра», «Теория вероятностей и математическая статистика», «Экономическая информатика», «Статистика». В связи с этим требования ко входным знаниям и умениям студентов обусловлены результатами изучения ими этих учебных курсов.

Для освоения данной дисциплины обучающийся должен:

Знать:

- основные термины экономической теории и их содержание;
- методологию высшей математики;
- основные способы способов получения, обработки и хранения информации.

Уметь:

- проводить теоретический анализ экономических объектов;
- применять математический анализ собранной информации;
- формировать информационную базу для анализа экономических объектов.

Владеть:

- навыками построения экономико-математических моделей;
- навыками факторного анализа.

3. Планируемые результаты обучения по дисциплине

3.1. Компетенции, формированию которых способствует данная дисциплина

При освоении дисциплины формируются следующие компетенции в соответствии с ФГОС ВО по данному направлению подготовки:

а) общекультурные (ОК):

ОК-1 - способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу;

б) общепрофессиональные (ОПК):

ОПК-3 – способность принимать организационно-управленческие решения

в) профессиональные (ПК)

ПК-7 - способность разрабатывать стратегии поведения экономических агентов на различных рынках;

ПК-10 – способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом.

3.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с



Основная профессиональная образовательная программа
38.04.01 Экономика
(Экономика фирмы и отраслевых рынков)

формируемыми компетенциями.

В результате освоения дисциплины обучающийся должен:

Знать:

основные определения и понятия изучаемых разделов эконометрики (ОК-1, ОПК-3).

Уметь:

оценивать параметры эконометрических моделей (ОК-1, ОПК-3, ПК-10);

выбирать эконометрическую модель, адекватно описывающую экономическую систему (ПК-7, ПК-10).

Владеть:

методами качественной и количественной оценки влияния различных факторов на экономические показатели (ОПК-3, ПК-7),

методами прогнозирования экономических показателей (ОК-1, ПК-10).

4. Объем и содержание дисциплины

Объем дисциплины составляет 2 зачетные единицы (72 академических часа)

4.1. Содержание дисциплины по разделам (темам), соотнесенное с видами и трудоемкостью занятий лекционно-семинарского типа

Объем иной контактной работы и самостоятельной работы обучающегося по дисциплине указан в учебном плане образовательной программы.

№ п/ п	Раздел дисциплины	Семестр	Виды учебных занятий, их объем (в ак. часах по очной форме обучения)		Формы текущего контроля успеваемости (по очной форме обучения)
			Занятия лекционного типа	Занятия семинарского типа	Формы промежуточной аттестации
1	Эконометрика и эконометрическое моделирование. Основные понятия.	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
2	Классическая линейная модель множественной регрессии	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
3	Линейная регрессионная модель с гетероскедастичными остатками	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
4	Линейная регрессионная модель с автокоррелированными остатками	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
5	Практические рекомендации по построению, анализу и интерпретации линейных	1		2ч. лабор. раб.	отчёт



Основная профессиональная образовательная программа
38.04.01 Экономика
(Экономика фирмы и отраслевых рынков)

	регрессионных моделей				
6	Линейные регрессионные модели с переменной структурой	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
7	Нелинейные регрессионные модели	1		4 ч. лабор. раб.	Каждая лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
8	Дихотомические результирующие показатели и дихотомическая регрессия.	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
9	Системы линейных одновременных уравнений	1		2 ч. лабор. раб.	Лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
10	Временные ряды	1		2 ч. лабор. раб.	Лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
11	Модели стационарных временных рядов	1		2 ч. лабор. раб.	Лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
12	Нестационарные временные ряды со стохастическим трендом (DS-ряды).	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
13	Модели нестационарных временных рядов	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
14	Регрессионные модели с распределёнными лагами	1		2 ч. лабор. раб.	Каждая лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
Итого по дисциплине				30	Зачет

№ п/п	Раздел дисциплины	Семестр	Виды учебных занятий, их объем (в ак. часах по очно-заочной форме обучения)		Формы текущего контроля успеваемости (по очно-заочной форме обучения)
			Занятия лекционного типа	Занятия семинарского типа	Формы промежуточной аттестации
1	Эконометрика и эконометрическое моделирование. Основные понятия.	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
2	Классическая линейная модель множественной регрессии	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
3	Линейная регрессионная модель с гетероскедастичными остатками	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт



Основная профессиональная образовательная программа
38.04.01 Экономика
(Экономика фирмы и отраслевых рынков)

4	Линейная регрессионная модель с автокоррелированными остатками	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
5	Практические рекомендации по построению, анализу и интерпретации линейных регрессионных моделей	1		2ч. лабор. раб.	отчёт
6	Линейные регрессионные модели с переменной структурой	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
7	Нелинейные регрессионные модели	1		4 ч. лабор. раб.	Каждая лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
8	Дихотомические результирующие показатели и дихотомическая регрессия.	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
9	Системы линейных одновременных уравнений	1		2 ч. лабор. раб.	Лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
10	Временные ряды	1		2 ч. лабор. раб.	Лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
11	Модели стационарных временных рядов	1		2 ч. лабор. раб.	Лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
12	Нестационарные временные ряды со стохастическим трендом (DS-ряды).	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
13	Модели нестационарных временных рядов	1		2 ч. лабор. раб.	отчёт
14	Регрессионные модели с распределёнными лагами	1		2 ч. лабор. раб.	Каждая лабораторная работа завершается составлением письменного отчёта
Итого по дисциплине				30	Зачет

4.2. Развернутое описание содержания дисциплины по разделам (темам)

1. Эконометрика и эконометрическое моделирование. Основные понятия.

Определение эконометрики как научной дисциплины. Основные понятия и проблемы эконометрического моделирования. Виды переменных эконометрической модели. Основные понятия и определения регрессионного анализа. Основные задачи регрессионного анализа. Метод наименьших квадратов. Статистические свойства оценок параметров классической модели. Проверка значимости коэффициентов регрессии и построение доверительных интервалов для классической модели. Прогнозирование на основе классической модели. Оценки точности прогнозирования.



2. Классическая линейная модель множественной регрессии

Классическая линейная модель множественной регрессии. Метод наименьших квадратов. Статистические свойства оценок параметров классической модели. Проверка значимости коэффициентов регрессии и построение доверительных интервалов для классической модели. Прогнозирование на основе классической модели. Оценки точности прогнозирования.

3. Линейная регрессионная модель с гетероскедастичными остатками

Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Обобщенный метод наименьших квадратов и его практическая реализация. Линейная модель с гетероскедастичными регрессионными остатками. Взвешенный метод наименьших квадратов. Проверка гипотезы о гетероскедастичности регрессионных остатков. Критерий Глейсера. Прогнозирование на основе модели с гетероскедастичными остатками. Оценки точности прогнозирования.

4. Линейная регрессионная модель с автокоррелированными остатками

Определение линейной регрессионной модели с автокоррелированными остатками. Реализация обобщенного метода наименьших квадратов в случае модели с автокоррелированными остатками. Проверка гипотезы о наличии автокоррелированности регрессионных остатков. Критерий Дарбина-Уотсона. Оценивание регрессии в условиях автокорреляции ошибок. Методы Хилдрета – Лу и Кохрейна – Оркатта оценивания линейных моделей со случайными остатками AR(1). Прогнозирование на основе модели с автокоррелированными остатками. Оценки точности прогнозирования.

5. Практические рекомендации по построению, анализу и интерпретации линейных регрессионных моделей

Мультиколлинеарность. Отбор наиболее значимых коэффициентов регрессии. Метод главных компонент. Оценка погрешности аппроксимационного варианта линейной регрессионной модели. Метод скользящего экзамена.

6. Линейные регрессионные модели с переменной структурой

Проблема неоднородных (в регрессионном смысле) данных. Фиктивные переменные. Учет взаимодействия сопутствующих переменных. Проверка регрессионной однородности двух групп наблюдений. Построение регрессионной модели по неоднородным данным при неизвестных значениях сопутствующих переменных.

7. Нелинейные регрессионные модели

Нелинейные модели регрессии. Линеаризация внутренне линейных моделей. Оценка параметров внутренне нелинейных моделей методами нелинейного программирования. Оценка ошибки параметров внутренне нелинейных моделей. Оценка коэффициентов эластичности.

8. Дихотомические результирующие показатели и дихотомическая регрессия.

Линейная вероятностная модель. Логит-анализ. Пробит-анализ. Цензурированные регрессии: тобит-анализ. Смещение при построении выборки.

9. Системы линейных одновременных уравнений

Определение системы линейных одновременных уравнений. Модель спроса-предложения как пример системы одновременных уравнений. Идентифицируемость уравнений системы и ее проверка. Рекурсивные системы и их идентификация. Косвенный и двухшаговый методы наименьших квадратов. Метод главных компонент в двухшаговом методе наименьших квадратов. Трехшаговый метод наименьших квадратов одновременной оценки всех параметров системы.



10. Временные ряды

Понятие временного ряда. Классификация основных факторов, формирующих значения временного ряда. Стационарный временной ряд. Нестационарные временные ряды, виды нестационарных временных рядов. Автоковариационная, автокорреляционная и частная автокорреляционная функции. Проверка гипотезы о неизменности среднего значения временного ряда. Методы сглаживания временных рядов. Разделение составляющих нестационарного временного ряда типа TS.

11. Модели стационарных временных рядов

Модели авторегрессии первого и второго порядка. Модели скользящего среднего первого и второго порядка. Авторегрессионные модели со скользящим средним в остатках. Идентификация моделей стационарных временных рядов. Автоковариационная, автокорреляционная и частная автокорреляционная функции моделей стационарных временных рядов. Обратимость моделей авторегрессии и скользящего среднего. Прогнозирование стационарных временных рядов и оценка ошибки прогноза.

12. Нестационарные временные ряды со стохастическим трендом (DS-ряды).

Последствия нестационарности. Обнаружение нестационарности. Кointеграция.

13. Модели нестационарных временных рядов

Оценивание моделей с нестационарными временными рядами.

14. Регрессионные модели с распределенными лагами

Интерпретация модели с распределенными лагами. Оценка параметров модели с распределенными лагами. Полиномиально распределённые лаги Алмон. Метод Койка.

5. Образовательные технологии

Организация учебного процесса осуществляется через лекции, практические занятия, индивидуальную самостоятельную работу студентов над курсом.

Используются следующие технологии и методы:

- кейс-технологии (разбор ситуаций, сложившихся на отечественных и зарубежных предприятиях);
- решения ситуационных задач;
- игровые технологии (анализ имитационных моделей, формат деловой игры);
- методы учебной дискуссии.

Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине: технологии смешанного обучения, мультимедиа технологии, технологии визуализации (инфографика).

6. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся

Самостоятельная работа студентов включает в себя работы по подготовке к занятиям семинарского типа, путем изучения лекционных материалов, учебной и тематической литературы (в том числе периодической и интернет-ресурсов), разбора и решения задач.

В ходе лабораторных работ в компьютерном классе учащиеся выполняют задания по разным вариантам.

Самостоятельная работа студентов организуется на основе использования методических указаний, интернет-ресурсов, предоставляющих материалы по тематике курса в свободном доступе (выход может осуществляться в компьютерных классах экономического факультета ИвГУ, дома).



Полностью весь методический материал по обеспечению самостоятельной работы студентов приводится в Приложении 1 к рабочей программе.

7. Характеристика оценочных средств для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине

Лабораторная работа посвящена самостоятельному выполнению каждым учащимся задания с составлением отчёта в электронной форме. Типовые варианты заданий к лабораторным работам находятся в приложении к рабочей программе в разделе «Фонд оценочных средств».

Для получения зачёта обучающийся должен располагать содержательными и завершёнными отчётами по всем полученным заданиям, по выбору преподавателя дать пояснения проведённому исследованию и интерпретировать полученные результаты.

8. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины.

Основная литература:

1. Кийко, П.В. Эконометрика. Продвинутый уровень: учебное пособие для магистрантов / П.В. Кийко, Н.В. Щукина. - М.; Берлин : Директ-Медиа, 2015. - 61 с.: URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=279003>

2. Носко, В.П. Эконометрика : учебник / В.П. Носко ; Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации. - М.: Издательский дом «Дело», 2011. - Кн. 1. - Ч. 1,2. - 673 с.: - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=444266>

Дополнительная литература:

1. Картаев. Ф.С. Эконометрика / Ф.С. Картаев, Е.Н. Лукаш; Московский государственный университет им. М. В. Ломоносова, Экономический факультет. - М.: Проспект, 2014. - 118 с. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=276567>

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

Система электронной поддержки образовательного процесса «Мой университет» <http://uni.ivanovo.ac.ru>

Профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

ЭБС «Университетская библиотека онлайн» www.biblioclub.ru

Электронная библиотека ИвГУ <http://lib.ivanovo.ac.ru>

Электронный каталог НБ ИвГУ <http://lib.ivanovo.ac.ru/index.php/ek>

Ивановостат www.ivanovo.gks.ru

Росстат www.gks.ru

Банк России (ЦБ): www.cbr.ru.

Московская Межбанковская валютная биржа: www.micex.ru.

Информационный портал Всемирного банка: <http://data.worldbank.org>.

Программное обеспечение:

операционная система Microsoft Windows, Internet Explorer, Microsoft Defender, Adobe Acrobat Reader, КонсультантПлюс, Moodle.



9. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Учебные аудитории:

- для проведения занятий лекционного типа с комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения, служащими для предоставления учебной информации большой аудитории;

- для проведения занятий семинарского типа, текущего контроля и промежуточной аттестации с комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения;

- для проведения групповых и индивидуальных консультаций с комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения;

Лаборатория, оснащенная лабораторным оборудованием, комплектом специализированной учебной мебели и техническими средствами обучения;

Помещение для самостоятельной работы, оснащенное комплектом специализированной учебной мебели, компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в ЭИОС.

Демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия для занятий лекционного типа, обеспечивающие тематические иллюстрации: демонстрационное оборудование, электронные пособия (презентации); аудио-визуальные пособия (аудиозаписи, видеоматериалы и т.п.), наглядные и печатные пособия.



Основная профессиональная образовательная программа
38.04.01 Экономика
(Экономика фирмы и отраслевых рынков)

Автор рабочей программы дисциплины: к.э.н., доц., доцент Савченко Татьяна Александровна

Программа рассмотрена и утверждена на заседании кафедры экономического анализа и бухгалтерского учета

« 13 » июне 20 18 г., протокол № 12

Программа обновлена

протокол заседания кафедры № 1 от « 2 » сентября 20 19 г.

Согласовано:

Руководитель ОП  Р.С. Ибрагимова
(подпись)

Программа обновлена

протокол заседания кафедры № _____ от « _____ » _____ 20 ____ г.

Согласовано:

Руководитель ОП _____ Р.С. Ибрагимова
(подпись)

Программа обновлена

протокол заседания кафедры № _____ от « _____ » _____ 20 ____ г.

Согласовано:

Руководитель ОП _____ Р.С. Ибрагимова
(подпись)