

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Кислова Наталья Николаевна

Должность: Проректор по УМР и качеству образования

Дата подписания: 21.07.2018 12:04:06

Уникальный программный ключ:

52802513f5b14a975b3e9b13008093d5726b159bf6064f865ae65b96a966c035

МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный социально-педагогический университет»

Кафедра экономики

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по УМР и КО,
председатель УМС СГСПУ

 Н.Н. Кислова

МОДУЛЬ "ПРОЕКТНО-МЕТОДИЧЕСКИЙ (ОБУЧЕНИЕ ЭКОНОМИКЕ)"

Эконометрика

рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой	Экономики	
Учебный план	ФЭУС-б20ЭИз(5гбм).plx Направленность подготовки: «Педагогическое образование (с двумя профилями подготовки)» Направленность (профиль) «Экономика» и «Информатика»	
Квалификация	бакалавр	
Форма обучения	заочная	
Общая трудоемкость	3 ЗЕТ	
Часов по учебному плану	108	Виды контроля в семестрах: зачеты с оценкой 2
в том числе:		
аудиторные занятия	8	
самостоятельная работа	96	
часы на контроль	4	

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр(Курс.Номер семестра на курсе)	2(1.2)		Итого	
	УП	РПД	УП	РПД
Вид занятий				
Лекции	2	2	2	2
Практические занятия	6	6	6	6
В том числе инт.	4	4	4	4
Итого ауд.	8	8	8	8
Контактная работа	8	8	8	8
Сам. работа	96	96	96	96
Часы на контроль	4	4	4	4
Итого	108	108	108	108

Направление подготовки 44.03.05: педагогическое образование (с двумя профилями подготовки), направленность (профиль) «Экономика» и «Информатика»
Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

Программу составил(и):
Зелепухин Ю.В.

При наличии обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья, которым необходим особый порядок освоения дисциплины (модуля), по их желанию разрабатывается адаптированная к ограничениям их здоровья рабочая программа дисциплины (модуля).

Рабочая программа дисциплины
Эконометрика

разработана в соответствии с ФГОС ВО:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 44.03.05 Педагогическое образование (с двумя профилями подготовки) (приказ Минобрнауки России от 22.02.2018 г. № 125)

составлена на основании учебного плана:

Направленность подготовки: 44.03.05 Педагогическое образование (с двумя профилями подготовки)
Направленность (профиль) «Экономика» и «Информатика»

утвержденного учёным советом вуза от 30.08.2019 протокол № 1.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры
Экономики

Протокол от 27.08.2019 г. №1
Зав. кафедрой Ю.П. Грабоздин

Начальник УОП



Н.А. Доманина

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Цель изучения дисциплины:

формирование у студентов практических навыков по применению статистических методов для исследования и обобщения эмпирических зависимостей экономических переменных, а также построения надежных прогнозов в различных сферах педагогической деятельности с целью обоснования принимаемых решений, формирование компетенций в соответствии с требованиями ФГОС по направлению подготовки 44.03.05 Педагогическое образование (с двумя профилями подготовки) и учебным планом.

Задачи изучения дисциплины:

изучить этапы эконометрического моделирования; изучить методы спецификации эконометрических моделей; познакомиться с видами эконометрических моделей и научиться их различать; освоить методику построения эконометрической модели и методы оценки их параметров; научиться оценивать качество эконометрических моделей; научиться применять эконометрические модели для имитации и прогнозирования экономических процессов.

Область профессиональной деятельности:

01 Образование и наука (в сфере дошкольного, начального общего, среднего общего образования, профессионального обучения, профессионального образования, дополнительного образования)

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП:

Б1.О.03

2.1 Требования к предварительной подготовке обучающегося:

Содержание дисциплины базируется на материале:

Основы экономической теории

микроэкономика

2.2 Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:

Бизнес-планирование

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ОПК-8. Способен осуществлять педагогическую деятельность на основе специальных научных знаний

ОПК-8.1. Знает: историю, теорию, закономерности и принципы построения и функционирования образовательного процесса, роль и место образования в жизни человека и общества, современное состояние научной области, соответствующей преподаваемому предмету; прикладное значение науки; специфические методы научного познания в объеме, обеспечивающем преподавание учебных предметов

Знает:

- основные понятия, категории и инструменты эконометрики;
- отличия классического и байесовского подходов к статическому оцениванию;
- принципы принятия и реализации экономических и управленческих решений
- числовые характеристики и функции распределения случайных величин, точечные и интервальные оценки параметров случайных величин;
- подходы к вычислению вероятностей;
- допущения, лежащие в основе линейной регрессионной модели
- меру качества уравнения регрессии (коэффициент детерминации)
- показатель тесноты корреляционной зависимости (коэффициент корреляции)
- основные положения метода наименьших квадратов (МНК), свойства оценок МНК;
- последствия нарушения допущений классической модели линейной регрессии, тесты на гетероскедастичность, автокорреляцию;
- понятие мультиколлинеарности, методы ее обнаружения и устранения;
- составляющие временного ряда;
- условия идентифицируемости системы одновременных уравнений;

Умеет:

- разработать и обосновать варианты эффективных хозяйственных решений
- применять эконометрические модели для исследования и обобщения эмпирических зависимостей экономических переменных
- дать экономическую интерпретацию коэффициентов эконометрической модели;
- определять форму связи между зависимой и объясняющими переменными эконометрической модели;
- рассчитывать числовые характеристики и функции распределения случайных величин, точечные и интервальные оценки параметров случайных величин.
- оценить тесноту и направление связи между переменными в эконометрической модели

Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

<ul style="list-style-type: none"> - производить оценку параметров уравнения множественной регрессии; - рассчитать на основе МНК коэффициенты регрессии, доверительные интервалы для функции регрессии и ее параметров, а также анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты; - строить на основе описания ситуаций стандартные эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты; - прогнозировать на основе стандартных эконометрических моделей поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений; - обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях; - оценить параметры регрессионной модели с помощью ОМНК; - рассчитывать и анализировать частные коэффициенты корреляции; - оценивать регрессию с помощью фиктивных переменных; - проводить линеаризацию моделей регрессии; - прогнозировать развитие рынков с использованием эконометрических моделей - осуществлять оценку управленческих решений с использованием эконометрических моделей - находить уравнение тренда для временного ряда и проверять его значимость; - дать точечный и интервальный прогнозы для среднего и индивидуального значений временного ряда; - провести сглаживание тренда временного ряда методом скользящих средних; - строить и проверять на адекватность модель авторегрессионной условной гетероскедастичности (ARCH); - строить и проверять на адекватность авторегрессионную модель скользящей средней ARMA; - проводить оценку системы одновременных уравнений. <p>Умеет:</p> <ul style="list-style-type: none"> - определить цель, образовательные результаты и средства их оценки, содержание и дидактический материал по учебному предмету «Эконометрика» в соответствии с требованиями образовательных стандартов.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Интер акт.
	Раздел 1. Введение в эконометрическое моделирование			
1.1	Основные аспекты эконометрического моделирования /Лек/	2/1	1	
1.2	Основные аспекты эконометрического моделирования /Пр/	2/1	0	
1.3	Основные аспекты эконометрического моделирования /Ср/	2/1	6	
1.4	Элементы теории вероятностей и математической статистики /Лек/	2/1	0	
1.5	Элементы теории вероятностей и математической статистики /Пр/	2/1	0	
1.6	Элементы теории вероятностей и математической статистики /Ср/	2/1	6	
	Раздел 2. Теория регрессионного анализа			
2.1	Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии /Лек/	2/1	1	
2.2	Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии /Пр/	2/1	1	1
2.3	Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии /Ср/	2/1	8	
2.4	Линейная модель множественной регрессии /Лек/	2/1	1	
2.5	Линейная модель множественной регрессии /Пр/	2/1	1	1
2.6	Линейная модель множественной регрессии /Ср/	2/1	8	
2.7	Метод наименьших квадратов (МНК) /Лек/	2/1	0	
2.8	Метод наименьших квадратов (МНК) /Пр/	2/1	1	
2.9	Метод наименьших квадратов (МНК) /Ср/	2/1	8	
2.10	Свойства оценок МНК /Ср/	2/1	4	
2.11	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками /Лек/	2/1	0	
2.12	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками /Пр/	2/1	1	
2.13	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками /Ср/	2/1	8	
2.14	Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК) /Лек/	2/1	0	
2.15	Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК) /Пр/	2/1	1	
2.16	Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК) /Ср/	2/1	6	

Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

2.17	Мультиколлинеарность. Регрессионные модели с переменной структурой. Фиктивные переменные /Лек/	2/1	0	
2.18	Мультиколлинеарность. Регрессионные модели с переменной структурой. Фиктивные переменные /Пр/	2/1	1	
2.19	Мультиколлинеарность. Регрессионные модели с переменной структурой. Фиктивные переменные /Ср/	2/1	8	
2.20	Нелинейные модели регрессии и их линейаризация /Лек/	2/1	0	
2.21	Нелинейные модели регрессии и их линейаризация /Пр/	2/1	0	
2.22	Нелинейные модели регрессии и их линейаризация /Ср/	2/1	6	
	Раздел 3. Практическое применение регрессионных моделей	2/1		
3.1	Характеристики временных рядов /Лек/	2/1	1	
3.2	Характеристики временных рядов /Пр/	2/1	1	1
3.3	Характеристики временных рядов /Ср/	2/1	8	
3.4	Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их классификация /Лек/	2/1	0	
3.5	Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их классификация /Пр/	2/1	0	
3.6	Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их классификация /Ср/	2/1	8	
3.7	Система линейных одновременных уравнений. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов /Лек/	2/1	0	
3.8	Система линейных одновременных уравнений. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов /Пр/	2/1	1	1
3.9	Система линейных одновременных уравнений. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов /Ср/	2/1	12	

5. Оценочные и методические материалы по дисциплине (модулю)

5.1. Содержание аудиторной работы по дисциплине (модулю)

1.1 Лекция. Основные аспекты эконометрического моделирования. Цель - формирование образовательных результатов по теме Рассматриваемые вопросы:

1. Основные этапы и проблемы эконометрического моделирования.
2. Задачи эконометрики в области социально-экономических исследований.
3. Понятия спецификации и идентифицируемости модели. Примеры эконометрических моделей (модель предложения и спроса на конкурентном рынке).

Литература:

1. Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

Контрольное мероприятие по Разделу 1

Задача. По данным задачи 2.6 найдите средний балл по обществознанию, разброс баллов относительно среднего значения. (Зелепухин Ю.В. Практикум по эконометрике: учебное пособие/Ю.В.Зелепухин.-Самара:ООО «Издательство АсГард»,2011.-71

2.1 Лекция Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии Цель – формирование образовательных результатов по теме Рассматриваемые вопросы:

1. Функциональная, статистическая и корреляционная зависимости.
2. Линейная парная регрессия.
3. Коэффициент корреляции.
4. Основные положения регрессионного анализа.
5. Интервальная оценка функции регрессии и ее параметров
6. Оценка значимости уравнения регрессии.

2.2 Практическое занятие Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии

Задача 1 Имеются следующие данные об уровне механизации работ (X,%) и производительностью труда (Y, т/ч) для 14 предприятий:

X	32	30	36	40	41	47	56	54	60	55	61	67	69	76
Y	20	24	28	30	31	33	34	37	38	40	41	43	45	48

Необходимо: Оценить тесноту и направление связи между переменными с помощью коэффициента корреляции.

Тест

ЗАДАНИЕ 1 (выберите один вариант ответа)

Эндогенные переменные ... ВАРИАНТЫ ОТВЕТОВ:

- 1) могут коррелировать с ошибками регрессии
- 2) не зависят от экзогенных переменных
- 3) влияют на экзогенные переменные
- 4) могут быть объектом регулирования

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

2.4 Лекция Линейная модель множественной регрессии

Цель – формирование образовательных результатов по теме Рассматриваемые вопросы:

- 1.Классическая нормальная линейная модель множественной регрессии.
- 2.Матричная форма модели множественной регрессии.
- 3.Предпосылки для множественного регрессионного анализа.
- 4.Оценка значимости множественной регрессии.

2.5 Практическое занятие. Линейная модель множественной регрессии

Задача Имеются условные данные о сменной добычи угля на одного рабочего (Y,т) , мощности пласта (X1,м) и уровне механизации работ (X2,%), характеризующие процесс добычи угля в 10 шахтах:

i	X i1	X i2	yi	i	X i1	X i2	yi
1	8	5	5	6	8	8	6
2	11	8	10	7	9	6	6
3	12	8	10	8	9	4	5
4	9	5	7	9	8	5	6
5	8	7	5	10	12	7	8

Получено уравнение регрессии в виде:

$$Y = -3.54 + 0.854X_1 + 0.367X_2$$

Требуется

1. Оценить математическое ожидание $M_x(Y)$ при $X_0(186)$

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

2.8 Практическое занятие. Метод наименьших квадратов (МНК)

Задача Имеется зависимость между сменной добычей угля на одного рабочего (Y) (т) и мощностью пласта (X)(м), полученная по п=10 шахтам:

Xi	8	11	12	9	8	8	9	9	8	12
Yi	5	10	10	7	5	6	6	5	6	8

Требуется найти:

- 1.уравнение регрессии (Y) по (X) и построить ее график
- 2.коэффициент корреляции между (Y) и (X)

3. сменную среднюю добычу угля на одного рабочего для шахт с мощностью пласта 8 м
4. 95% -ые доверительные интервалы для индивидуального и среднего значений сменной добычи угля на одного рабочего для шахт с мощностью пласта 8м
5. с надежностью 0.95 интервальные оценки коэффициента регрессии (В1) и дисперсии

Тест
ЗАДАНИЕ N 1 (выберите несколько вариантов ответа)
Метод наименьших квадратов применим к уравнениям регрессии ... ВАРИАНТЫ ОТВЕТОВ:
1) которые отражают нелинейную зависимость между двумя экономическими показателями и не могут быть приведены к линейному виду 2) которые отражают нелинейную зависимость между двумя экономическими показателями, но могут быть приведены к линейному виду
3) нелинейного вида 4) которые отражают линейную зависимость между двумя экономическими показателями

ЗАДАНИЕ N 2 (выберите несколько вариантов ответа)
Несмещенность оценки характеризуется ...
ВАРИАНТЫ ОТВЕТОВ:
1) зависимостью от объема выборки значения математического ожидания остатков 2) максимальной дисперсией остатков
3) равенством нулю математического ожидания остатков 4) отсутствием накопления остатков при большом числе выборочных оцениваний

Литература:
1. Путько, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путько, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

2.12 Практическое занятие Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками
Задача. В таблице приведены данные по 18 наблюдениям модели пространственной выборки. Предполагая, что ошибки регрессии представляют собой нормально распределенные случайные величины, проверить гипотезу о гомоскедастичности, используя тест Голдфелда – Квандта.

I	X _i	e _i	I	X _i	E _i
1	21.3	2.3	10	71.5	23.8
2	22.6	5.6	11	75.7	45.7
3	32.7	12.8	12	76	34.7
4	41.9	10.1	13	78.9	56.9
5	43.8	14.6	14	79.8	56.8
6	49.7	13.9	15	80.7	49.8
7	56.9	24	16	80.8	58.9
8	59.7	21.9	17	96.9	87.8
9	67.8	19.7	18	97	87.5

Литература:
1. Путько, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путько, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

2.15 Практическое занятие Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК)

Задача Для линейного однофакторного уравнения регрессии

$$Y_t = A_0 + A_1 X_t + \varepsilon_t \quad t = 1, 2, \dots, T$$

Имеется T=12 пар наблюдений целевой переменной (Y) и экзогенной переменной (X), которые представлены в таблице

X _t	5	2.5	1.8	6.8	9	3.8	6.5	9	1	3.5	7.1	10
Y _t	5	4.8	3.1	8.2	8.6	5.5	6.5	11.1	2.1	4.5	8.9	11.8

Для ошибки уравнения (ε_t) выполняются предположения авторегрессии первого порядка с известными значениями

$$\rho = -0.4 \text{ и } \sigma^2_{\varepsilon_t} = 1. \text{ Требуется оценить параметры уравнения } (A_0) \text{ и } (A_1) \text{ с помощью ОМНК.}$$

Тест

ЗАДАНИЕ - (выберите один вариант ответа)

Обобщенный МНК применяется в случае... ВАРИАНТЫ ОТВЕТОВ:

- 1) наличия в остатках гетероскедастичности или автокорреляции
- 2) наличия в модели фиктивных переменных
- 3) наличия в модели мультиколлинеарности
- 4) наличия в модели незначимых оценок

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

2.18. Практическое занятие Мультиколлинеарность. Регрессионные модели с переменной структурой. Фиктивные переменные

Задача 1. Для переменной «заработная плата» представлена модель:
$$Y_t = \alpha_0 + \alpha_1 X_{1t} + \alpha_2 X_{2t} + \varepsilon_t$$

Y_t – логарифм совокупной заработной платы

X_{1t} – количество лет обучения

X_{2t} – опыт работы

$$\varepsilon_t \approx (0, \sigma^2)$$

Выборка составлена таким образом, что номера от 1 до 100 соответствуют женщинам, а со 101 по 300 – мужчинам

Требуется:

Предложить два способа представления нулевой гипотезы, что заработная плата мужчины для данного уровня образования и опыта работы выше, чем у женщины с такими же характеристиками

Задача. Для исследования зависимости между производительностью труда X1, возрастом X2 и производственным стажем X3 была произведена выборка из 100 рабочих одной и той же специальности. Вычисленные парные коэффициенты корреляции оказались значимыми и составили : $r_{12} = 0.2, r_{13} = 0.41, r_{23} = 0.82$. Вычислить частные коэффициенты корреляции и оценить их значимость на уровне $\alpha = 0.05$.

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер ; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва : Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4 ; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

Контрольное мероприятие по разделу 2

Задача. По предприятиям легкой промышленности Самарского региона получена информация, характеризующая зависимость объема выпуска продукции (Y , млн. руб.) от объема капиталовложений (X , млн. руб.)

X	66	58	73	82	81	84	55	67	81	59
Y	133	107	145	162	163	170	104	132	159	116

Задание:

1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи между объемом выпуска продукции (Y) (млн.руб.) и объемом капиталовложений (X , млн. руб.)
2. Оцените тесноту связи между объемом выпуска продукции (Y , млн. руб.) объемом капиталовложений (X , млн. руб.) с помощью выборочного коэффициента корреляции. Проверьте его значимость ($\alpha = 0.1$).
3. Рассчитайте оценки параметров уравнения парной регрессии.
4. Проверьте значимость оценки (\hat{b}) параметра регрессии с помощью критерия Стьюдента при уровне значимости $\alpha = 0.1$. Сделайте экономический вывод. Постройте 90%- доверительный интервал для коэффициента регрессии (b). Дайте экономическую интерпретацию.
5. Проверьте значимость оценки (\hat{a}) параметра регрессии с помощью критерия Стьюдента при уровне значимости $\alpha = 0.1$. Постройте 90%- доверительный интервал для свободного члена уравнения (a).
6. Рассчитайте выборочный коэффициент детерминации. Сделайте экономический вывод. Оцените с помощью F-критерия Фишера значимость уравнения регрессии ($\alpha = 0.1$).
7. Рассчитайте объем выпуска продукции (\hat{y}_0), если объем капиталовложений составит 70 млн.руб.. Постройте 90% доверительный интервал для прогнозного значения объясняемой переменной (y_0). Сделай экономический вывод.
8. На поле корреляции постройте линию регрессии.

3.1 Лекция. Характеристики временных рядов
Цель – формирование образовательных результатов

Рассматриваемые вопросы:

1. Временной ряд и этапы его анализа.
2. Составляющие временного ряда
3. Аналитическое выравнивание временного ряда.
- 3.2 Практическое занятие. Характеристики временных рядов

Задача В таблице приведены данные, отражающие спрос на товар за восьмилетний период:

Год, t	1	2	3	4	5	6	7	8
Спрос, U_t Усл.ед.	213	171	291	309	317	362	351	361

Найти уравнение тренда для временного ряда U_t , полагая тренд линейным, проверить значимость уравнения тренда по F - критерию на 5%-ном уровне значимости.

ТЕСТЫ

1. Построена аддитивная модель временного ряда, где Y_t – временной ряд, T_t – трендовая компонента, S_t – сезонная компонента, E_t – случайная компонента. Если $Y_t = 15$, то правильно найдены значения компонент ряда ...

$$T_t = 8, \quad S_t = 5, \quad E_t = 0$$

$$T_t = 8, \quad S_t = 5, \quad E_t = 2$$

$$T_t = 15, \quad S_t = 5, \quad E_t = 0$$

$$T_t = 15, \quad S_t = -5, \quad E_t = 2$$

2. В результате сглаживания временного ряда 6, 2, 7, 5, 12 простой четырехчленной скользящей средней первое сглаженное значение равно ...

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

3.8 Практическое занятие Система линейных одновременных уравнений

Задача. Имеется макроэкономическая модель:

$$C_t = \alpha_1 + \alpha_2 Y_t + \alpha_3 r_t + \varepsilon_{1t}$$

$$I_t = \beta_1 + \beta_2 Y_t + \beta_3 U_{t-1} + \varepsilon_{2t}$$

$$r_t = \gamma_1 + \gamma_2 I_t + \gamma_3 M_t + \varepsilon_{3t}$$

$$Y_t = C_t + I_t + G_t$$

Требуется: Описать процедуру оценивания уравнений по 2МНК

Литература:

1.Путко, Б.А. Эконометрика: учебник / Б.А. Путко, Н.Ш. Кремер; ред. Н.Ш. Кремер. - 3-е изд., перераб. и доп. - Москва: Юнити-Дана, 2012. - 329 с. - (Золотой фонд российских учебников). - ISBN 978-5-238-01720-4; То же [Электронный ресурс]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251>

Контрольное мероприятие по разделу 3

Задача В таблице приведены данные, отражающие прибыль предприятия за восьмилетний период:

Год, t	1	2	3	4	5	6	7	8
Прибыль, У _t у.д.е.	213	171	291	309	317	362	351	361

Провести сглаживание временного ряда У_t методом скользящих средних, используя простую среднюю арифметическую с интервалом сглаживания m=3 года. Дать точечную и с надежностью 0.95 интервальную оценки прогноза среднего и индивидуального значений прибыли предприятия на момент t=9 (девятый год).

5.2. Содержание самостоятельной работы по дисциплине (модулю)

Содержание обязательной самостоятельной работы по дисциплине

№ п/п	Темы дисциплины	Содержание самостоятельной работы студентов	Продукты деятельности
1	Основные аспекты эконометрического моделирования	Напишите развернутый ответ на тему «Некоторые аспекты эконометрической методологии». Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 2 стр.	Письменная работа
2	Элементы теории вероятностей и математической статистики	Приведите пример принятия экономического решения в условиях риска и неопределенности. Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 1 стр.	Письменная работа
3	Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии	Дайте развернутый ответ на вопрос: «Какие задачи решает прикладной регрессионный анализ)? Письменная работа выполняется от руки на листе А4, максимальный объем работы – 1 стр.	Письменная работа
4	Линейная модель множественной регрессии	Решите тест на знание классической нормальной линейной модели множественной регрессии	Письменная работа

Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

5	Метод наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК	Решить задачу на умение - рассчитать на основе МНК параметры уравнения регрессии, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;	Письменная работа
6	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками	Решить задачу на умение - обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях	Письменная работа
7	Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК)	Напишите развернутый ответ на тему: В чем состоит суть обобщенной регрессионной модели Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.	Письменная работа
8	Мультиколлинеарность. Регрессионные модели с переменной структурой. Фиктивные переменные	Напишите развернутый ответ на тему «Как можно обнаружить мультиколлинеарность?» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 2 стр.	Письменная работа
9	Нелинейные модели регрессии и их линеаризация	1.Подготовьте развернутый ответ на тему: «Нелинейные модели регрессии» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.	Письменная работа
10	Характеристики временных рядов	Напишите развернутый ответ на тему: «Временные ряды» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 3 стр.	Письменная работа
11	Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их классификация	Напишите развернутый ответ на тему «Каким образом строится авторегрессионная модель скользящей средней ARMA»? Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 3 стр.	Письменная работа
12	Система линейных одновременных уравнений	Решите тесты. 1.В структурной форме модели, построенной по указанной схеме взаимосвязей между переменными, количество экзогенных переменных равно ... 	Письменная работа

Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

		<p>2. Количество уравнений системы для указанной схемы взаимосвязей между переменными равно ...</p>	
--	--	---	--

Содержание самостоятельной работы по дисциплине на выбор студента

№ п/п	Темы дисциплины	Содержание самостоятельной работы студентов	Продукты деятельности
1.	Основные аспекты эконометрического моделирования	Подготовьте информационный обзор на тему «Проблемы эконометрического прогнозирования». Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 2 стр.	Письменная работа
2	Элементы теории вероятностей и математической статистики	Напишите развернутый ответ на тему «Подходы к вычислению вероятностей». Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 2 стр.	Письменная работа
3	Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии	<p>Дайте развернутый ответ на вопрос: «В чем разница между регрессией и корреляцией?»</p> <p>Письменная работа выполняется от руки на листе А4, максимальный объем работы – 1 стр.</p>	Письменная работа
4	Линейная модель множественной регрессии	Решите задачу на умение производить оценку параметров уравнения множественной регрессии	Письменная работа
5	Метод наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК	Решить задачу на умение - рассчитать на основе МНК параметры уравнения регрессии, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;	Письменная работа
6	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками	Решить задачу на умение обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях	Письменная работа
7	Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК)	Решить задачу на умение - оценить параметры регрессионной модели с помощью ОМНК	Письменная работа
8	Мультиколлениарность. Регрессионные модели с переменной структурой. Фиктивные переменные	Решить задачу на умение оценивать регрессию с помощью фиктивных переменных	Письменная работа

Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

9	Нелинейные модели регрессии и их линеаризация	Приведите к линейному виду логарифмическую и степенную функции. Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.	Письменная работа
10	Характеристики временных рядов	Напишите развернутый ответ на тему: «Анализ временных рядов» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.	Письменная работа
11	Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их классификация	Пример задания. Напишите развернутый ответ на тему «Нестационарные временные ряды» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 3 стр.	Письменная работа
12	Система линейных одновременных уравнений	Решите тесты 1.Приведенная форма модели, соответствующая структурной форме системы одновременных уравнений (несколько вариантов ответа) $\begin{cases} y_1 = b_{12}y_2 + a_{11}x_1 + \varepsilon_1, \\ y_2 = b_{21}y_1 + a_{22}x_2 + \varepsilon_2 \end{cases}$ включает в себя уравнения а. $y_2 = a_{22}x_2 + \varepsilon_2$ б. $y_1 = \delta_{11}x_1 + u_1$ с. $y_2 = \delta_{22}x_2 + u_2$ д. $y_1 = \delta_{11}x_1 + \delta_{12}x_2 + u_1$ е. $y_2 = \delta_{21}x_1 + \delta_{22}x_2 + u_2$ Для идентифицируемой структурной формы системы одновременных уравнений при оценке параметров применяется ... а.Обычный метод наименьших квадратов б.Косвенный метод наименьших квадратов с.Двухшаговый метод наименьших квадратов д.Трехшаговый метод наименьших квадратов	Письменная работа

5.3.Образовательные технологии

При организации изучения дисциплины будут использованы следующие образовательные технологии: информационно-коммуникационные технологии, технология организации самостоятельной работы, технология рефлексивного обучения, технология модульного обучения, технология игрового обучения, технологии групповой дискуссии, интерактивные технологии, технология проблемного обучения, технология организации учебно-исследовательской деятельности, технология проектного обучения, технология развития критического мышления.

5.4. Текущий контроль, промежуточный контроль и промежуточная аттестация

Балльно-рейтинговая карта дисциплины оформлена как приложение к рабочей программе дисциплины. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине оформлен отдельным документом.

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие, ссылка на электронную библиотечную систему	Издательство, год
Л1.1	Путко Б. А., Кремер Н. Ш.	Эконометрика: учебник http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=118251	Москва: Юнити-Дана, 2012
Л1.2	Под редакцией: Афанасьева В.Н.	Эконометрика: учебник http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=260747	Оренбург: Оренбургский государственный университет, 2012

6.1.2. Дополнительная литература

	Авторы, составители	Заглавие, ссылка на электронную библиотечную систему	Издательство, год
Л2.1	Грибанова Е. Б.	Эконометрика: учебное пособие http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=480470	Томск: ТУСУР, 2014
Л2.2	Шиловская Н. А.	Эконометрика: учебное пособие http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=436404	Архангельск: САФУ, 2013
Л2.3	Под редакцией: Афанасьева В.Н.	Эконометрика для бакалавров: учебник http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=330491	Оренбург: ООО ИПК «Университет», 2014
Л2.4	гл. ред. С.А. Айвазян	Прикладная эконометрика: научно-практический журнал http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=429916	Москва: 4. Синергия ПРЕСС, 2014

6.2 Перечень программного обеспечения

- Acrobat Reader DC
- Dr.Web Desktop Security Suite, Dr.Web Server Security Suite
- GIMP
- Microsoft Office 2016 Professional Plus (Пакет программ Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher)
- Microsoft Office 365 Pro Plus - subscription license (12 month) (Пакет программ Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher, Skype for Business, OneDrive, SharePoint Online)
- Microsoft Windows 10 Education
- Microsoft Windows 7/8.1 Professional
- XnView
- Архиватор 7-Zip
- Программная система для обнаружения текстовых заимствований в учебных и научных работах «Антиплагиат.ВУЗ»

6.3 Перечень информационных справочных систем

- Информационно-образовательная программа «Росметод»
- СПС «ГАРАНТ-Аналитик»
- СПС «Консультант-Плюс»
- Elsevier (база данных «Freedom Collection» и коллекции электронных книг «Freedom Collection eBook collection»),
- SCOPUS издательства Elsevier
- SpringerNature (национальная подписка на полнотекстовые ресурсы)
- База данных международных индексов научного цитирования Web of Science
- БД «Polpred.com. Обзор СМИ»
- УИС РОССИЯ

- ЭБС «E-LIBRARY.RU»
- ЭБС «РУКОНТ» (Контекстум)
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн»
- ЭБС «ЮРАЙТ» (Коллекция Легендарные книги)
- ЭБС «IPRbooks»

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1	Наименование специального помещения: помещение для самостоятельной работы, Читальный зал. Оснащенность: ПК-4шт., Принтер-1шт., Телефон-1шт., Письменный стол-4 шт., Парта-2 шт.
7.2	Наименование специального помещения: учебная аудитория для проведения лекционных занятий, практических занятий, групповых консультаций, индивидуальных консультаций, текущего контроля, промежуточной аттестации, Учебная аудитория. Оснащенность: Меловая доска-1шт., Комплект учебной мебели, ноутбук, проекционное оборудование (мультимедийный проектор и экран).

8. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Работа над теоретическим материалом происходит кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы, формулировки, обобщения; пометить важные мысли, выделять ключевые слова, термины. Проверка терминов, понятий с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь. Обозначить вопросы, термины, материал, который вызывает трудности, пометить и попытаться найти ответ в рекомендуемой литературе. Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю.

Проработка рабочей программы дисциплины, уделяя особое внимание целям и задачам, структуре и содержанию дисциплины. Конспектирование источников, подготовка ответов к контрольным вопросам, просмотр рекомендуемой литературы, работа с информационными источниками в разных форматах.

Также в процессе изучения дисциплины методические рекомендации могут быть изданы отдельным документом.

Курс 1 Семестр 2

Вид контроля		Минимальное количество баллов	Максимальное количество баллов
Раздел 1. Введение в эконометрическое моделирование			
1	Аудиторная работа	0	2
2	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	0	2
3	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	0	2
Контрольное мероприятие по Разделу 1		0	14
Итого по Разделу 1		0	20
Раздел 2. Теория регрессионного анализа			
1	Аудиторная работа	0	4
2	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	0	4
3	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	0	4
Контрольное мероприятие по Разделу 2		0	38
Итого по Разделу 2		0	50
Разделу 3. Практическое применение регрессионных моделей			
1	Аудиторная работа	0	3
2	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	0	3
3	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	0	3
Контрольное мероприятие по Разделу 3		0	21
Итого по Разделу 3		0	30
Промежуточная аттестация (по всем Разделам)		0	100
Семестровый рейтинг по дисциплине		56	100

Таблица 2

Вид контроля		Примеры заданий, критерии оценки и количество баллов	Темы для изучения и образовательные результаты
Раздел 1. Введение в эконометрическое моделирование			
Текущий контроль по Разделу			Основные аспекты эконометрического моделирования
1	Аудиторная работа	<p>Пример задания.</p> <p>1. Ответьте на контрольные вопросы семинара:</p> <p>1. Сформулируйте задачу эконометрического моделирования. 1.2. Назовите основные этапы эконометрического моделирования и дайте их характеристику</p> <p>Решите задачи на умение дать экономическую интерпретацию коэффициентов эконометрической модели определять форму связи между зависимой и объясняющими переменными эконометрической модели</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара и правильное решение задачи - 1 балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Знать:</p> <p>- основные понятия, категории и инструменты эконометрики; основные этапы эконометрического моделирования</p> <p>Уметь:</p> <p>дать экономическую интерпретацию коэффициентов регрессии эконометрической модели; - определять форму связи между зависимой и объясняющими переменными эконометрической модели</p>
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания.</p> <p>Напишите развернутый ответ на тему «Некоторые аспекты эконометрической методологии» Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 2 стр.</p> <p>Критерии оценки</p> <p>1. Указана философия, которой следует придерживаться в эконометрическом моделировании (1 балл)</p> <p>2. Определены отличия классического и</p>	<p>Знать:</p> <p>- философию эконометрического моделирования, отличия классического и байесовского подходов к статистическому оцениванию, уровень неопределенности, с каким приходится сталкиваться эконометристу.</p>
		<p>байесовского подходов к статистическому оцениванию (1 балл)</p> <p>3. Определен уровень неопределенности, с каким приходится сталкиваться эконометристу (0,5 балла) В противном случае 0 баллов</p>	

	Самостоятельная работа на (специальные формы выбор студента)	<p>Пример задания. Подготовьте информационный обзор на тему «Проблемы эконометрического прогнозирования». Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 2 стр.</p> <p>Критерии оценки</p> <p>1. Указаны допущения, лежащие в основе традиционных подходов к экономическому прогнозированию, а также подходы к прогнозированию, которые можно считать адекватными реальности (1 балл.) В противном случае 0 баллов.</p>	
Текущий контроль по Разделу			Элементы теории вероятностей и математической статистики.
2	Аудиторная работа	<p>Пример задания. Ответьте на контрольные вопросы семинара: Назовите основные числовые характеристики случайной величины Что такое точечные и интервальные оценки параметров случайных величин? 2.Решите задачи на умения рассчитывать числовые характеристики и функции распределения случайных величин, точечные и интервальные оценки параметров случайных величин.</p> <p>Критерии оценки Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара и правильное решение задач -1балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Знать: числовые характеристики и функции распределения случайных величин, точечные и интервальные оценки параметров случайных величин. Уметь: рассчитывать числовые характеристики и функции распределения случайных величин, точечные и интервальные оценки параметров случайных величин.</p>
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания. Приведите пример принятия экономического решения в условиях риска и неопределенности. Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 1 стр.</p> <p>Критерии оценки Адекватность примера формулировке задания оценивается в 1 балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Уметь: - использовать потенциал учебного предмета «Экономическая теория» при решении экономических задач</p>

	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	<p>Пример задания. Напишите развернутый ответ на тему «Подходы к вычислению вероятностей». Работа выполняется на стандартном листе формата А4 от руки, максимальный объем работы – 2 стр. Критерии оценки Приведены 4 подхода к вычислению вероятностей. Все подходы адекватно прокомментированы. (1 балл). В противном случае 0 баллов.</p>	Знать: подходы к вычислению вероятностей
	Контрольное мероприятие по Разделу 1	<p>Пример задания. Решите задачу на умение рассчитывать числовые характеристики случайных величин Критерии оценки Правильное решение задачи - 14 баллов. В противном случае 0 баллов.</p>	Уметь: рассчитывать числовые характеристики случайных величин
Промежуточный контроль			

Раздел 2. Теория регрессионного анализа			
	Текущий контроль по Разделу		Парный регрессионный анализ. Показатели качества регрессии
3	Аудиторная работа	<p>Пример задания. Ответьте на контрольные вопросы семинара: Назовите основные задачи регрессионного анализа Назовите виды зависимостей между случайными величинами Какие допущения лежат в основе линейной модели? Что является мерой качества уравнения регрессии? Как можно оценить тесноту корреляционной зависимости? 2. Решите задачу на умение оценить тесноту и направление связи между переменными в эконометрической модели (представлены ниже) 3. Решите тест на знание корреляционной зависимости (представлен ниже) Критерии оценки Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, правильное решение теста и задач - 0.5 балла. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Знать: функциональную, статистическую, корреляционную зависимости, основные задачи регрессионного анализа, допущения, лежащие в основе линейной регрессионной модели, меру качества уравнения регрессии и показатель тесноты корреляционной зависимости Уметь: - оценить тесноту и направление связи между переменными в эконометрической модели</p>

	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания. Дайте развернутый ответ на вопрос: «Какие задачи решает прикладной регрессионный анализ?» Письменная работа выполняется от руки на листе А4, максимальный объем работы – 1 стр. Критерии оценки 1 Задачи, решением которых занимается прикладной регрессионный анализ верно отнесены к одному из трех типов в соответствии с рекомендациями Айвазяна С.А. Теория вероятности и прикладная статистика.М.: ЮНИТИ-ДАНА,2010. Задачи адекватно прокомментированы и проиллюстрированы примерами (0,5баллов). В противном случае 0 баллов.</p>	Знать: основные задачи регрессионного анализа
	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	<p>Пример задания. Дайте развернутый ответ на вопрос: «В чем разница между регрессией и корреляцией»? Письменная работа выполняется от руки на листе А4, максимальный объем работы – 1 стр. Критерии оценки Верно указаны не менее двух существенных различий с иллюстрацией примеров. (0.5 балла). В противном случае 0 баллов</p>	Уметь: различать регрессию и корреляцию
Текущий контроль по Разделу			Линейная модель множественной регрессии
4	Аудиторная работа	<p>Пример задания. 1. Ответьте на контрольные вопросы семинара: 1.1. Что представляет собой классическая нормальная линейная модель множественной регрессии 2. Решите задачу на умение - применять эконометрические модели для исследования и обобщения эмпирических зависимостей экономических переменных -производить оценку параметров уравнения множественной регрессии</p>	<p>Знать: классическую нормальную линейную модель множественной регрессии Уметь: - применять эконометрические модели для исследования и обобщения эмпирических зависимостей экономических переменных - производить оценку параметров уравнения</p>
		<p>Критерии оценки Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, и правильное решение задачи -0,5баллов. В противном случае 0 баллов.</p>	множественной регрессии

	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания.</p> <p>1. Решите тест на знание классической нормальной линейной модели множественной регрессии</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильное решение теста -0.5 балла. В противном случае 0 баллов.</p>	знать классическую нормальную линейную модель множественной регрессии
	Самостоятельная работа на (специальные формы выбор студента)	<p>Пример задания.</p> <p>Решите задачу на умение производить оценку параметров уравнения множественной регрессии</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильное решение задачи -0,5балла. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Уметь:</p> <p>- производить оценку параметров уравнения множественной регрессии</p>
Текущий	контроль по Разделу		<p>Метод наименьших квадратов (МНК)</p> <p>Свойства оценок МНК</p>
5	Аудиторная работа	<p>Пример задания.</p> <p>1. Ответьте на контрольные вопросы семинара:</p> <p>1. В чем заключается метод наименьших квадратов?</p> <p>2. Назовите свойства оценок МНК</p> <p>Решите задачу на умение - рассчитать на основе МНК коэффициенты регрессии, доверительные интервалы для функции регрессии и ее параметров, а также анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;</p> <p>Решите тесты на знание метода наименьших квадратов и свойств оценок МНК</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, и правильное решение тестов и задач -1балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>знать метод наименьших квадратов (МНК), свойства оценок МНК</p> <p>Уметь:</p> <p>- рассчитать на основе МНК коэффициенты регрессии, доверительные интервалы для функции регрессии и ее параметров, а также анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;</p>
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания.</p> <p>Решить задачу на умение - рассчитать на основе МНК параметры уравнения регрессии, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильное решение задачи -1 балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Уметь:</p> <p>- рассчитать на основе МНК параметры уравнения регрессии, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;</p>

	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	Пример задания. Решить задачу на умение - рассчитать на основе МНК параметры уравнения регрессии, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты; Критерии оценки Правильное решение задачи - 1 балл. В противном случае 0 баллов.	Уметь: - рассчитать на основе МНК параметры уравнения регрессии, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;
Текущий	контроль по Разделу		Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокорреляционными остатками
6	Аудиторная работа	Пример задания. 1. Ответьте на контрольные вопросы семинара: 1.1 Каковы последствия имеют нарушения допущений классической модели линейной регрессии? 2. Решите задачу на умение обнаруживать	знать последствия нарушения допущений классической модели линейной регрессии, тесты на обнаружение гетероскедастичности и автокорреляции регрессионных остатков
		явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях Критерии оценки Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, и правильное решение задачи -1балл. В противном случае 0 баллов.	Уметь: - обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	Пример задания. Решить задачу на умение - обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях Критерии оценки Правильное решение задачи -1,5 балла. В противном случае 0 баллов.	Уметь: - обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях
	Самостоятельная работа (специальные формы выбора студента)	Пример задания. Решить задачу на умение обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях Критерии оценки Правильное решение задачи - 0,5 балла. В противном случае 0 баллов.	Уметь: - обнаруживать явление гетероскедастичности в линейных регрессионных моделях

Направление подготовки 44.03.05: педагогическое образование (с двумя профилями подготовки), направленность (профиль) «Экономика» и «Информатика»
Рабочая программа дисциплины «Эконометрика»

Текущий контроль по Разделу			Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК).
7	Аудиторная работа	<p>Пример задания. Решите задачу на умение - оценить параметры регрессионной модели с помощью ОМНК</p> <p>Решите тест на знание обобщенной линейной модели множественной регрессии и обобщенного метода наименьших квадратов. Критерии оценки</p> <p>Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, и правильное решение тестов и задач -0.5баллов. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Уметь:</p> <p>- оценить параметры регрессионной модели с помощью ОМНК</p>
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания. Напишите развернутый ответ на тему: В чем состоит суть обобщенной регрессионной модели</p> <p>Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.</p> <p>Критерии оценки</p> <p>1.Представлены обобщенная и классическая модели множественной регрессии</p> <p>2.Приведены все предпосылки для множественного регрессионного анализа для классической и обобщенной линейной модели</p> <p>3.Проведено сравнение видов ковариационных матриц классической и обобщенной модели</p> <p>4.Сделан правильный вывод в отличиях. (0,5 балла.) В противном случае 0 баллов.</p>	<p>знать обобщенную линейную модель множественной регрессии</p>
	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	<p>Пример задания. Решить задачу на умение - оценить параметры регрессионной модели с помощью ОМНК</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильное решение задачи - 0,5 балла. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Уметь:</p> <p>- оценить параметры регрессионной модели с помощью ОМНК</p>
Текущий контроль по Разделу			<p>Мультиколлинеарность.</p> <p>Регрессионные модели с переменной структурой.</p> <p>Фиктивные переменные</p>

8	Аудиторная работа	Пример задания. 1. Ответьте на контрольные вопросы семинара:	Знать: мультиколлинеарность и методы ее обнаружения и устранения, фиктивные
		1.1 Что такое мультиколлинеарность? 1.2 Назовите методы ее обнаружения и устранения 1.3. Что такое фиктивные переменные? 2. Решите задачи на умение --оценивать регрессию с помощью фиктивных переменных - рассчитать и анализировать частные коэффициенты корреляции Критерии оценки Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, и правильное решение задач -0.5балла. В противном случае 0 баллов.	Переменные Уметь: - рассчитать и анализировать частные коэффициенты корреляции -оценивать регрессию с помощью фиктивных переменных
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	Пример задания. Напишите развернутый ответ на тему «Как можно обнаружить мультиколлинеарность?» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 2 стр. Критерии оценки 1. Раскрыта терминология вопроса 2. Указаны последствия мультиколлинеарности 3. Указаны виды мультиколлинеарности Представлены не менее 4 эвристических подходов по ее выявлению с адекватными комментариями Предложены (не менее 2) методов устранения или уменьшения этого явления. (0,5 балла) В противном случае 0 баллов.	знать мультиколлинеарность и методы ее обнаружения
	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	Пример задания. Решить задачу на умение оценивать регрессию с помощью фиктивных переменных Критерии оценки Правильное решение задачи -0,5 балла. В противном случае 0 баллов.	Уметь: - оценивать регрессию с помощью фиктивных переменных
Текущий контроль по Разделу			Нелинейные модели регрессии и их линеаризация

9	Аудиторная работа	<p>Пример задания.</p> <p>1. Решите задачу на умение проводить линеаризацию моделей регрессии 2. Решите тест на знание нелинейных моделей регрессии (см ниже)</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильные ответы на вопросы теста и правильное решение задачи -0.5балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Знать: нелинейные модели регрессии</p> <p>Уметь:</p> <p>- проводить линеаризацию моделей регрессии</p>
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания.</p> <p>1.Подготовьте развернутый ответ на тему: «Нелинейные модели регрессии»</p> <p>Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Указан тест на проверку адекватности линейной модели анализируемым данным</p> <p>Приведены примеры (не менее 2) нелинейных моделей.</p> <p>Представлены (не менее 2) подходы для оценки параметров нелинейных моделей (0,5 балла) В противном случае 0 баллов.</p>	<p>знать нелинейные модели регрессии</p>
	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	<p>Пример задания.</p> <p>Приведите к линейному виду логарифмическую и степенную функции.</p>	<p>Уметь:</p> <p>- проводить линеаризацию моделей регрессии</p>
		<p>Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Функции приведены к линейному виду верно (0,5 баллов).</p> <p>В противном случае 0 баллов.</p>	
	Контрольное мероприятие по Разделу 2	<p>Пример задания</p> <p>Решить задачу на умение:</p> <p>-строить на основе описания ситуаций стандартные эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты; - прогнозировать на основе стандартных эконометрических моделей поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильное решение задачи -38 балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>Уметь:</p> <p>- строить на основе описания ситуаций стандартные эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты; -прогнозировать на основе стандартных эконометрических моделей поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений;</p>
	Промежуточный контроль		

Раздел 3 . Практическое применение регрессионных моделей			
Текущий контроль по Разделу			Характеристики временных рядов.
10	Аудиторная работа	<p>Пример задания.</p> <p>1.Решите задачу на умение - находить уравнение тренда для временного ряда и проверять его значимость 2. Решите тест на знание временного ряда и его составляющих</p> <p>Критерии оценки</p> <p>Правильные ответы на тесты и правильное решение задачи -1балл. В противном случае 0 баллов.</p>	<p>знать временной ряд, его составляющие.</p> <p>Уметь: - находить уравнение тренда для временного ряда и проверять его значимость</p>
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	<p>Пример задания.</p> <p>Напишите развернутый ответ на тему: «Временные ряды» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 3 стр. Критерии оценки (выполнение критериев 1 балл)</p> <p>1. Дано определение временного ряда 2. Указаны области практического применения временного ряда (не менее 2) 3. Выделены основные составляющие временного ряда (все 4)</p>	<p>знать временной ряд, его составляющие</p>
	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	<p>Пример задания.</p> <p>Напишите развернутый ответ на тему: «Анализ временных рядов» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 1 стр.</p> <p>Критерии оценки (выполнение критериев 1 балл)</p> <p>1.Приведены (не менее 4) этапы анализа временных рядов</p> <p>2.Указаны (не менее 2) методы анализа временных рядов</p>	<p>знать этапы и методы анализа временного ряда</p>
Текущий контроль по Разделу			Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их классификация.
11	Аудиторная работа	<p>Пример задания.</p> <p>1.Ответьте на контрольные вопросы семинара:</p> <p>1.1 Дайте характеристику стационарных временных рядов?</p> <p>1.2. Какие линейные модели используются для анализа временных рядов? 1.3 Назовите нелинейные модели</p>	<p>Знать:</p> <p>-стационарные временные ряды, их характеристику -линейные модели для анализа временных рядов (модель MA, AR, ARMA)</p> <p>- нелинейные модели временного ряда (ARCH,</p>

		временного ряда? 2. Решите задачу на умение строить и проверять на адекватность модель авторегрессионной условной гетероскедастичности (ARCH) Критерии оценки Правильное решение задачи и правильные ответы на контрольные вопросы семинара -1балл. В противном случае 0 баллов.	GARCH) Уметь: -строить и проверять на адекватность модель авторегрессионной условной гетероскедастичности (ARCH)
	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	Пример задания. Напишите развернутый ответ на тему «Каким образом строится авторегрессионная модель скользящей средней ARMA»? Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 3 стр. Критерии оценки (выполнение критериев 1 балл) 1. Перечислены три этапа построения модели (подход Бокса-Дженкинса) 2. Указано как производится идентификация модели ARMA 3. Дана характеристика информационным критериям Акаике, Шварца, Хеннана-Куинна 4. Указано как производится оценка модели	Уметь: -строить и проверять на адекватность авторегрессионную модель скользящей средней ARMA
	Самостоятельная работа на (специальные формы выбор студента)	Пример задания. Напишите развернутый ответ на тему «Нестационарные временные ряды» Письменная работа выполняется от руки на листе А4. Максимальный объем работы 3 стр. Критерии оценки (выполнение критериев 1 балла) 1.Приведены основные типы нестационарных временных рядов (не менее2) 2.Указаны способы приведения нестационарных временных рядов к стационарным (не менее 2) 3. Указано назначение теста Дики-Фуллера для анализа нестационарных временных рядов	Знать: - нестационарные временные ряды, основные типы и способы приведения к стационарному временному ряду
Текущий контроль по Разделу			Система линейных одновременных уравнений. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.
12	Аудиторная работа	Пример задания. 1.1. Что представляет собой система одновременных уравнений? 1.2 Назовите инструменты анализа систем одновременных уравнений 2. Решите задачу на умение проводить оценку системы одновременных уравнений Критерии оценки Правильные ответы на все контрольные вопросы семинара, и правильное решение задачи -1балл. В противном случае 0 баллов.	Знать систему одновременных уравнений, инструменты анализа- косвенный, двухшаговый, трехшаговый методы наименьших квадратов, Уметь: - проводить оценку системы одновременных уравнений

	Самостоятельная работа (специальные обязательные формы)	Пример задания. Решите тесты на знание структурной формы системы одновременных уравнений Критерии оценки (выполнение -1 балл)	знать структурную форму системы одновременных уравнений
	Самостоятельная работа (специальные формы на выбор студента)	Пример задания. Решите тесты на знание приведенной формы системы одновременных уравнений Критерии оценки Правильное выполнение 1 балл	знать приведенную форму и условия идентифицируемости системы одновременных уравнений
Контрольное мероприятие по Разделу 3		Пример задания. 1.Решить задачу на умение - дать точечный и интервальный прогнозы для среднего и индивидуального значений временного ряда - провести сглаживание тренда временного ряда методом скользящих средних 2. Письменная работа на тему: Определить цель, образовательные результаты и средства их достижения, содержание и дидактический материал по учебному предмету «Эконометрика» в соответствии с требованиями образовательных стандартов Критерии оценки Правильное решение задачи и работы - 21 баллов. В противном случае 0 баллов.	Уметь: - дать точечный и интервальный прогнозы для среднего и индивидуального значений временного ряда - провести сглаживание тренда временного ряда методом скользящих средних Умеет: - определить цель, образовательные результаты и средства их достижения, содержание и дидактический материал по учебному предмету «Эконометрика» в соответствии с требованиями образовательных стандартов

