

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Бианкина Алена Олеговна
Должность: Ректор
Дата подписания: 27.03.2026 20:57:27
Уникальный программный ключ:
b2aeadef209e4ec32d89f812db7eed614bb00b0c

Автономная некоммерческая организация высшего образования

Институт социальных наук

Департамент Экономики, управления, менеджмента и бизнес-информатики

УТВЕРЖДАЮ

РЕКТОР
БИАНКИНА А.О.
Протокол № 7 от 25 марта 2024



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.07 Эконометрика (продвинутый уровень)

Направление подготовки 38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) программы Финансовый анализ и оценка инвестиционных решений

Уровень высшего образования *Магистратура*

Год начала подготовки 2024

Москва – 2024 г.

СОДЕРЖАНИЕ

I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ.....	3
Цель и задачи освоения дисциплины	3
Место дисциплины в структуре образовательной программы	3
Объем дисциплины и виды учебной работы.....	3
Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине	4
II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	6
III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	8
РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА	9
ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ.....	9
ПЕРЕЧЕНЬ ЭЛЕКТРОННО-ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫХ РЕСУРСОВ	Ошибка! Закладка не определена.
ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ	10
ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ	10
ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ.....	10
МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ	10
IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ	11
V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ.....	11
VI. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ	11

I. ОРГАНИЗАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКИЙ РАЗДЕЛ

Цель и задачи освоения дисциплины

Целью дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» является формирование у магистрантов научного представления о методах, моделях и приемах, позволяющих строить модели экономических процессов с использованием эконометрических подходов и современных программных средств.

Задачи дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)»:

- теоретическое освоение студентами методов оценки, анализа и прогноза экономических показателей, характеризующих состояние и развитие экономических систем;
- приобретение практических методов для решения прикладных задач финансовой экономики;
- освоение современных информационных технологий для решения эконометрических задач.

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый уровень)» относится к обязательной части учебного плана.

Объем дисциплины и виды учебной работы

Таблица 1

Показатели объема дисциплины	Всего часов по формам обучения		
	очная	очно-заочная*	заочная*
Объем дисциплины в зачетных единицах	4 ЗЕТ		
Объем дисциплины в акад. часах	144		
Промежуточная аттестация: форма	зачет	-	-
Контактная работа обучающихся с преподавателем (Контакт. часы), всего:	24	-	-
1. Аудиторная работа (Ауд.), акад. часов всего, в том числе:	22	-	-
• лекции	12	-	-
• практические занятия	10	-	-
• лабораторные занятия	-	-	-
в том числе практическая подготовка	-	-	-
2. Индивидуальные консультации (ИК)(заполняется при наличии по дисциплине курсовых работ/проектов)	-	-	-
3. Контактная работа по промежуточной	2	-	-

аттестации (Катт) <i>(заполняется при наличии по дисциплине курсовых работ/проектов)</i>			
4. Консультация перед экзаменом (КЭ)	-	-	-
5. Контактная работа по промежуточной аттестации в период экз. сессии / сессии заочников (Каттэк)	-		-
Самостоятельная работа (СР), всего:	<i>120</i>	-	-
в том числе:			
• самостоятельная работа в период экз. сессии (СРэк) <i>(заполняется при наличии экзамена по дисциплине)</i>	-	-	
• самостоятельная работа в семестре (СРС)	<i>120</i>	-	-
в том числе, самостоятельная работа на курсовую работу <i>(заполняется при наличии по дисциплине курсовых работ/проектов)</i>	-	-	-
• изучение ЭОР <i>(при наличии)</i>		-	-
• изучение онлайн-курса или его части		-	-
• выполнение индивидуального или группового проекта		-	-
• <i>и другие виды</i>		-	-

Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине

Таблица 2

Формируемые компетенции <i>(код и наименование компетенции)</i>	Индикаторы достижения компетенций <i>(код и наименование индикатора)</i>	Результаты обучения <i>(знания, умения)</i>
ОПК-2. Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях	ОПК-2.3. Использует продвинутый логико-методологический инструментальный экономического анализа для оценки современных исследований	Знает современный инструментальный экономического анализа
		Умеет использовать методы и инструменты экономического анализа
ОПК-3. Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике.	ОПК-3.3. Приводит выводы на основании критического подхода к результатам научных исследований	Знает современные подходы к анализу результатов научных исследований в экономике, а также к их оценке и обобщению.
		Умеет применять на практике методики анализа, оценки и обобщения результатов научных исследований и формулировать

		собственные суждения на основе критического подхода к оценке результатов научных исследований
ОПК-5. Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	ОПК-5.3. Использует современные информационные технологии и программные средства при обработке финансово-экономических показателей для выбора управленческих решений	Знает методы обработки и анализа финансово-экономической информации, в том числе с использованием цифровых платформ, интеллектуальных информационно-аналитических систем, технологий искусственного интеллекта
		Умеет использовать интеллектуальные информационно-аналитические системы анализа финансово-экономической информации для выбора обоснования управленческих решений

II. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

этапы формирования и критерии оценивания сформированности компетенций

Таблица 3

№ п/п	Наименование раздела, темы дисциплины	Трудоемкость, академические часы						Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения (знания, умения)	Учебные задания для аудиторных занятий	Текущий контроль	Задания для творческого рейтинга (по теме(-ам)/разделу или по всему курсу в целом)
		Лекции	Практические занятия	Лабораторные занятия	Практическая подготовка	Самостоятельная работа	Всего					
		Семестр 2										

1.	Тема 1. Введение в эконометрику. Определение эконометрики. Цель и задачи эконометрики. Взаимосвязь эконометрики с другими науками. Эконометрические данные. Эконометрические модели. Эконометрические переменные. Этапы проведения эконометрических исследований. Виды зависимостей между экономическими переменными.	2	2	-	-	10	14	ОПК-2.3 ОПК-3.3 ОПК-5.3	<p><u>Знает:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - современный инструментарий экономического анализа; - современные подходы к анализу результатов научных исследований в экономике, а также к их оценке и обобщению; - методы обработки и анализа финансово-экономической информации, в том числе с использованием цифровых платформ, интеллектуальных информационно-аналитических систем, технологий искусственного интеллекта <p><u>Умеет:</u></p> <ul style="list-style-type: none"> - использовать методы и инструменты экономического анализа; - применять на практике методики анализа, оценки и обобщения результатов научных 	О.	Т.	-
----	---	---	---	---	---	----	----	-------------------------------	--	----	----	---

2.	Тема 2. Эконометрические модели с одним регрессионным уравнением. Парная регрессия. Множественная регрессия.	4	4	-	-	40	48	исследований и формулировать собственные суждения на основе критического подхода к оценке результатов научных исследований; - использовать интеллектуальные информационно-аналитические системы анализа финансово-экономической информации для выбора обоснования управленческих решений	О.	Т., З.	-
3.	Тема 3. Системы эконометрических уравнений. Системы уравнений, применяемых в эконометрике. Идентификация. Оценка параметров.	2	2	-	-	30	34		О.	Т., З.	-
4.	Тема 4. Модели временных рядов. Основные компоненты временного ряда. Выявление структуры временного ряда. Моделирование тенденции ряда. Построение аддитивной и мультипликативной моделей временного ряда.	4	2	-	-	40	46		О.	Т., З.	-
Итого		12	10	-	-	120	142				Д.

Формы учебных заданий на аудиторных занятиях:

Опрос (О.)

Групповая дискуссия (Гр.д.)

Формы текущего контроля:

Тест (Т.)

Контрольные работы (К/р)

Расчетно-аналитические задания или иные задания и задачи (р.а.з.)

Формы заданий для творческого рейтинга:

Доклад с презентацией (ДП)

Индивидуальный и/или групповой проект (Ин.п./Гр.п.)

III. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

РЕКОМЕНДУЕМАЯ ЛИТЕРАТУРА

Основная литература:

1. Тимофеев, В. С. Эконометрика : учебник для академического бакалавриата и магистратуры / В. С. Тимофеев, А. В. Фаддеенков, В. Ю. Щёколдин. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 328 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-4366-5. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/425245>
2. Демидова, О. А. Эконометрика : учебник и практикум для прикладного бакалавриата и магистратуры / О. А. Демидова, Д. И. Малахов. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 334 с. — (Бакалавр. Прикладной курс). — ISBN 978-5-534-00625-4. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/432950>
3. Галочкин, В. Т. Эконометрика : учебник и практикум для бакалавриата и специалитета / В. Т. Галочкин. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 288 с. — (Бакалавр и специалист). — ISBN 978-5-534-10751-7. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/431440>

Дополнительная литература:

1. Кремер, Н. Ш. Эконометрика: учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путько ; под редакцией Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 308 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-08710-9. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/426241>
2. Эконометрика : учебник для бакалавриата и магистратуры / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 449 с. — (Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/431129>
3. Евсеев, Е. А. Эконометрика : учебное пособие для бакалавриата и специалитета / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 186 с. — (Бакалавр и специалист). — ISBN 978-5-534-10752-4. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/431441>
4. Мардас, А. Н. Эконометрика : учебник и практикум для академического бакалавриата / А. Н. Мардас. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 180 с. — (Бакалавр. Академический курс). — ISBN 978-5-9916-8164-3. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/434110>
5. Костюнин, В. И. Эконометрика : учебник и практикум для прикладного бакалавриата / В. И. Костюнин. — Москва : Издательство Юрайт, 2019. — 285 с. — (Бакалавр. Прикладной курс). — ISBN 978-5-534-02660-3. — Текст : электронный // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/432126>

ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННО-СПРАВОЧНЫХ СИСТЕМ

1. <http://www.consultant.ru> - Справочно-правовая система Консультант Плюс;
2. <http://www.garant.ru> - Справочно-правовая система Гарант.

ПЕРЕЧЕНЬ ПРОФЕССИОНАЛЬНЫХ БАЗ ДАННЫХ

1. <http://www.gks.ru> - Росстат – федеральная служба государственной статистики
2. <http://www.iep.ru/ru/publikacii/categories.html> - Федеральный образовательный портал. Экономика. Социология. Менеджмент
3. <https://www.nalog.ru/rn39/program/> - База программных средств налогового учета
4. <https://rosmintrud.ru/opendata> - База открытых данных Минтруда России
5. www.economy.gov.ru - Базы данных Министерства экономического развития и торговли России
6. <http://www.fedsfm.ru/opendata> - База открытых данных Росфинмониторинга
7. <https://www.polpred.com> - Электронная база данных "Polpred.com Обзор СМИ"

ПЕРЕЧЕНЬ РЕСУРСОВ ИНФОРМАЦИОННО-ТЕЛЕКОММУНИКАЦИОННОЙ СЕТИ "ИНТЕРНЕТ", НЕОБХОДИМЫХ ДЛЯ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1. <https://www.coursera.org/learn/ekonometrika> - Курс эконометрики на платформе Coursera.
2. <https://c1339.c.3072.ru/> - Электронно-информационно-образовательная среда Moodle.
3. <http://appliedeconometrics.cemi.rssi.ru/> - Журнал «Прикладная эконометрика».

ПЕРЕЧЕНЬ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ, ИСПОЛЬЗУЕМЫХ ПРИ ОСУЩЕСТВЛЕНИИ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО ПРОЦЕССА ПО ДИСЦИПЛИНЕ, ВКЛЮЧАЯ ПЕРЕЧЕНЬ ПРОГРАММНОГО ОБЕСПЕЧЕНИЯ

Операционная система Windows 10, Microsoft Office Professional Plus: 2019 год (MS Word, MS Excel, MS Power Point, MS Access)

Антивирус Dr.Web Desktop Security Suite Комплексная защита

Браузер Google Chrome

Media Player Classic

МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый уровень)» обеспечена:

для проведения занятий лекционного типа:

- учебной аудиторией, оборудованной учебной мебелью, мультимедийными средствами обучения для демонстрации лекций-презентаций;

для проведения занятий семинарского типа (*практические занятия, лабораторные занятия*):

- учебной аудиторией, оборудованной учебной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации: для самостоятельной работы, в том числе для курсового проектирования;
- помещением для самостоятельной работы, оснащённым компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде института.

IV. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

- Методические рекомендации по организации и выполнению внеаудиторной самостоятельной работы.
- Методические указания по подготовке и оформлению рефератов.

V. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ И УМЕНИЙ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Результаты текущего контроля и промежуточной аттестации формируют рейтинговую оценку работы обучающегося. Распределение баллов при формировании рейтинговой оценки работы обучающегося осуществляется в соответствии с «Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний студентов в процессе освоения дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» в АНОВО «Институт социальных наук»

Таблица 4

Виды работ	Максимальное количество баллов
Выполнение учебных заданий на аудиторных занятиях	20
Текущий контроль	20
Творческий рейтинг	20
Промежуточная аттестация (<i>зачет</i>)	40
ИТОГО	100

В соответствии с Положением о рейтинговой системе оценки успеваемости и качества знаний обучающихся «преподаватель кафедры, непосредственно ведущий занятия со студенческой группой, обязан проинформировать группу о распределении рейтинговых баллов по всем видам работ на первом занятии учебного модуля (семестра), количестве модулей по учебной дисциплине, сроках и формах контроля их освоения, форме промежуточной аттестации, снижении баллов за несвоевременное выполнение выданных заданий. Обучающиеся в течение учебного модуля (семестра) получают информацию о текущем количестве набранных по дисциплине баллов через личный кабинет студента».

VI. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Оценочные средства по дисциплине разработаны в соответствии с Положением о фонде оценочных средств в АНОВО «Институт социальных наук»

Тематика курсовых работ/проектов:

Курсовая работа/проект по дисциплине «Эконометрика (продвинутый уровень)» учебным планом не предусмотрена

Типовой перечень вопросов к зачету:

1. Определение, предмет и методы эконометрики. Взаимосвязь с другими науками.
2. Классификация задач эконометрики.
3. Эконометрические данные и модели.
4. Классификация эконометрических переменных.
5. Этапы эконометрического исследования.
6. Значение эконометрики на современном этапе развития экономики.
7. Корреляционно-регрессионный анализ, как основной метод эконометрики.
8. Спецификация модели в случае парной регрессии. Ошибки спецификации.
9. Функции, применяемые в парной регрессии для описания взаимосвязей между экономическими переменными.
10. Методы выбора функции в парной регрессии.
11. Линейная регрессия и корреляция: оценка тесноты связи, оценка параметров уравнения регрессии, экономическая интерпретация параметров уравнения регрессии.
12. Линейная регрессия и корреляция: оценка значимости уравнения регрессии и его параметров, характеристика качества уравнения регрессии.
13. Прогнозирование по линейному уравнению парной регрессии: построение точечного и интервального прогнозов.
14. Нелинейная регрессия: регрессии, нелинейные по переменным, и регрессии, нелинейные по оцениваемым параметрам (внутренне линейные и нелинейные). Особенности оценки параметров.
15. Нелинейная регрессия: показатели корреляции, оценка значимости уравнения регрессии.
16. Нелинейная регрессия: оценка параметров.
17. Показатели качества подбора нелинейного уравнения регрессии: средняя ошибка аппроксимации, остаточная дисперсия, коэффициент детерминации.
18. Спецификация модели множественной регрессии: выбор формы уравнения.
19. Экономическая интерпретация параметров линейного и степенного уравнения регрессии.
20. Спецификация модели множественной регрессии: проблема отбора факторов.
21. Коллинеарность и мультиколлинеарность факторов, способы устранения и учета мультиколлинеарности.
22. Множественная регрессия: оценка параметров уравнения регрессии.
23. Метод наименьших квадратов (МНК), предпосылки его использования.
24. Свойство оценок МНК.
25. Частные уравнения регрессии. Интерпретация параметров.
26. Множественная и частная корреляция.
27. Множественная регрессия: оценка значимости уравнения регрессии и его параметров.
28. Проблема гетероскедастичности.
29. Обобщенный метод наименьших квадратов.
30. Производственные функции и их основные характеристики.
31. Производственная функция Кобба-Дугласа.
32. Фиктивные переменные во множественной регрессии.
33. Системы уравнений, используемых в эконометрике.
34. Структурная и приведенная формы модели.
35. Проблема идентификации: необходимое и достаточное условия идентификации.

36. Методы оценки параметров структурной модели: косвенный метод наименьших квадратов.
37. Методы оценки параметров структурной модели: двухшаговый метод наименьших квадратов.
38. Применение систем эконометрических уравнений: мультипликаторная макроэкономическая модель Кейнса.
39. Временной ряд: основные элементы. Аддитивная и мультипликативная формы модели.
40. Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры.
41. Моделирование тенденции временного ряда.
42. Моделирование сезонных и циклических колебаний в случае аддитивной модели.
43. Моделирование сезонных и циклических колебаний в случае мультипликативной модели.
44. Использование фиктивных переменных при моделировании сезонных колебаний.
45. Моделирование тенденции временного ряда при наличии структурных изменений.

Типовые тестовые задания:

1. Задачами регрессионного анализа являются:
 - а) выбор показателя, характеризующего тесноту связи между переменными.
 - б) оценка неизвестных параметров функции регрессии;
 - в) установление формы зависимости между переменными;
 - г) оценка тесноты связи между переменными;

2. При исследовании зависимости балансовой прибыли предприятия торговли (Y , тыс. руб.) от фонда оплаты труда (X_1 , тыс. руб.) и объема продаж по безналичному расчету (X_2 , тыс. руб.) получена следующая модель:

$$Y = 5933,100 + 0,916X_1 + 0,065X_2 + \varepsilon.$$
 Как интерпретируется коэффициент при факторном признаке X_1 :
 - а) при увеличении фонда оплаты труда на 1% балансовая прибыль предприятия торговли в среднем будет увеличиваться на 9,16%;
 - б) при увеличении только фонда оплаты труда на 1% балансовая прибыль предприятия торговли в среднем будет увеличиваться на 0,916%;
 - в) при увеличении только фонда оплаты труда на 1 тыс. руб. балансовая прибыль предприятия торговли будет увеличиваться на 0,916 тыс. руб.;
 - г) при уменьшении только фонда оплаты труда на 1 тыс. руб. балансовая прибыль предприятия торговли в среднем будет уменьшаться на 0,916 тыс. руб.

3. Если дисперсия остатков модели множественной регрессии не является постоянной величиной, то говорят о наличии в модели:
 - а) мультиколлинеарности;
 - б) гетероскедастичности;
 - в) автокорреляции;
 - г) гомоскедастичности.

4. Изучается зависимость спроса на товар (Y , руб.) от дохода населения (X , тыс. руб.) по двум регионам (А, В). Сколько фиктивных переменных, характеризующих проживание опрошенных в том или ином регионе, необходимо включить в уравнение регрессии:

- а) 1;
- б) 2;
- в) 3;
- г) 4.

5. Исследуется потребление продукта Р в трех регионах А, В, С. Были введены следующие фиктивные переменные: z_1 (1 - регион А, 0 - в остальных случаях) и z_2 (1 - регион В, 0 - в остальных случаях), и получено следующее уравнение $Y = b_0 + b_1z_1 + b_2z_2 + \varepsilon$.

Чему равен объем потребления продукта Р в регионе В:

- а) b_0 ;
- б) $b_0 + b_1$;
- в) b_1 ;
- г) $b_0 - b_1$.

Типовые расчетно-аналитические задания/задачи:

Задача 1.

Исследуя спрос на телевизоры марки N , аналитический отдел компании ABC по данным, собранным по 19 торговым точкам компании, выявил следующую зависимость:

$$\ln y = \frac{10.5}{(2.5)} - \frac{0.8}{(-4.0)} \ln x + \varepsilon,$$

где y - объем продаж телевизоров марки N в отдельной торговой точке;

x - средняя цена телевизора в данной торговой точке;

В скобках приведены фактические значения t -критерия Стьюдента для соответствующих параметров уравнения регрессии.

До проведения этого исследования администрация компании предполагала, что эластичность спроса по цене для телевизора марки N составляет -0.9 . Необходимо выяснить, подтвердилось ли предположение администрации результатами исследования.

Задача 2.

Для трех видов продукции A , B и C модели зависимости удельных постоянных расходов от объема выпускаемой продукции выглядят следующим образом:

$$y_A = 600,$$

$$y_B = 80 + 0.7x,$$

$$y_C = 40x^{0.5}.$$

1. Необходимо определить коэффициенты эластичности по каждому виду продукции и пояснить их смысл.

2. Сравнить при $x=1000$ эластичности затрат для продукции B и C .

3. Определить, каким должен быть объем выпускаемой продукции, чтобы коэффициенты эластичности для продукции B и C были равны.

Примеры вопросов для опроса:

1. Определение, предмет и методы эконометрики. Взаимосвязь с другими науками.
2. Классификация задач эконометрики.

3. Эконометрические данные и модели.
4. Классификация эконометрических переменных.
5. Этапы эконометрического исследования.

Тематика докладов:

1. Эконометрические данные и модели.
2. Значение эконометрики на современном этапе развития экономики.
3. Линейная парная регрессия и корреляция.
4. Нелинейная парная регрессия.
5. Спецификация модели множественной регрессии.

Типовая структура зачетного задания

<i>Наименование оценочного средства</i>	<i>Максимальное количество баллов</i>				
Вопрос 1. Определение, предмет и методы эконометрики. Взаимосвязь с другими науками.	10				
Вопрос 2. Метод наименьших квадратов (МНК), предпосылки его использования.	10				
<p>Практическое задание (расчетно-аналитическое):</p> <p>Зависимость объема производства y (тыс. ед.) от численности занятых x (чел.) по 15 заводам концерна характеризуется следующим образом:</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 50%;">Уравнение регрессии</td> <td>$y=30 - 0.4 x + 0.04 x^2$</td> </tr> <tr> <td>Доля остаточной дисперсии</td> <td>20 %</td> </tr> </table> <p><i>Задание</i> Необходимо определить:</p> <ol style="list-style-type: none"> а) индекс корреляции; б) значимость уравнения регрессии; в) коэффициент эластичности, предполагая, что численность занятых составляет 30 человек. 	Уравнение регрессии	$y=30 - 0.4 x + 0.04 x^2$	Доля остаточной дисперсии	20 %	20
Уравнение регрессии	$y=30 - 0.4 x + 0.04 x^2$				
Доля остаточной дисперсии	20 %				

Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения, шкала оценивания

Таблица 5

Шкала оценивания		Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
85 – 100 баллов	«отлично»/ «зачтено»	ОПК-2. Способен применять продвинутое инструментальные	ОПК-2.3. Использует продвинутой логико-	Знает верно и в полном объеме: продвинутое инструментальные	Продвинутый

		методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях	методологический инструментарий экономического анализа для оценки современных исследований	методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях Умеет верно и в полном объеме: использовать продвинутый логико-методологический инструментарий экономического анализа для оценки современных исследований	
70 – 84 баллов	«хорошо»/ «зачтено»			Знает с незначительными замечаниями: продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях Умеет с незначительными замечаниями: использовать продвинутый логико-методологический инструментарий экономического анализа для оценки современных исследований	Повышенный
50 – 69 баллов	«удовлетворительно»/ «зачтено»			Знает на базовом уровне, с ошибками: продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях Умеет на базовом уровне, с ошибками: использовать продвинутый логико-методологический инструментарий	Базовый

				экономического анализа для оценки современных исследований	
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»/ «не зачтено»			<p>Не знает на базовом уровне: продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях</p> <p>Не умеет на базовом уровне: использовать продвинутый логико-методологический инструментарий экономического анализа для оценки современных исследований</p>	Компетенции не сформированы
85 – 100 баллов	«отлично»/ «зачтено»			<p>Знает верно и в полном объеме: способы обобщения и критической оценки научных исследования в экономике.</p> <p>Умеет верно и в полном объеме: делать выводы на основании критического подхода к результатам научных исследований</p>	Продвинутый
70 – 84 баллов	«хорошо»/ «зачтено»	ОПК-3. Способен обобщать и критически оценивать научные исследования в экономике.	ОПК-3.3. Приводит выводы на основании критического подхода к результатам научных исследований	<p>Знает с незначительными замечаниями: способы обобщения и критической оценки научных исследования в экономике.</p> <p>Умеет с незначительными замечаниями: делать выводы на основании критического подхода к результатам научных исследований</p>	Повышенный
50 – 69 баллов	«удовлетворительно»/ «зачтено»			Знает на базовом уровне, с ошибками:	Базовый

				<p>способы обобщения и критической оценки научных исследования в экономике.</p> <p>Умеет на базовом уровне, с ошибками: делать выводы на основании критического подхода к результатам научных исследований</p>	
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»/ «не зачтено»			<p>Не знает на базовом уровне: способы обобщения и критической оценки научных исследования в экономике.</p> <p>Не умеет на базовом уровне: делать выводы на основании критического подхода к результатам научных исследований</p>	Компетенции не сформированы
85 – 100 баллов	«отлично»/ «зачтено»	ОПК-5. Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	ОПК-5.3. Использует современные информационные технологии и программные средства при обработке финансово-экономических показателей для выбора управленческих решений	<p>Знает верно и в полном объеме: современные информационные технологии и программные средства решения профессиональных задач</p> <p>Умеет верно и в полном объеме: использовать современные информационные технологии и программные средства при обработке финансово-экономических показателей для выбора управленческих решений</p>	Продвинутый
70 – 84 баллов	«хорошо»/ «зачтено»			<p>Знает с незначительными замечаниями: современные информационные технологии и программные средства решения профессиональных</p>	Повышенный

			задач Умеет с незначительными замечаниями: использовать современные информационные технологии и программные средства при обработке финансово-экономических показателей для выбора управленческих решений	
50 – 69 баллов	«удовлетворительно»/ «зачтено»		Знает на базовом уровне, с ошибками: современные информационные технологии и программные средства решения профессиональных задач Умеет на базовом уровне, с ошибками: использовать современные информационные технологии и программные средства при обработке финансово-экономических показателей для выбора управленческих решений	Базовый
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»/ «не зачтено»		Не знает на базовом уровне: современные информационные технологии и программные средства решения профессиональных задач Не умеет на базовом уровне: использовать современные информационные технологии и программные средства при обработке	Компетенции не сформированы

				финансово-экономических показателей для выбора управленческих решений	
--	--	--	--	---	--

Автономная некоммерческая организация высшего образования

Институт социальных наук

Департамент экономики, управления, менеджмента и бизнес-информатики

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.07 Эконометрика (продвинутый уровень)

Направление подготовки

38.04.01 Экономика

Направленность (профиль) программы Финансовый анализ и оценка инвестиционных решений

Уровень высшего образования

Магистратура

Москва – 2024г.

1. Цель и задачи дисциплины:

Целью дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» является формирование у магистрантов научного представления о методах, моделях и приемах, позволяющих строить модели экономических процессов с использованием эконометрических подходов и современных программных средств.

Задачи дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)»:

- теоретическое освоение студентами методов оценки, анализа и прогноза экономических показателей, характеризующих состояние и развитие экономических систем;
- приобретение практических методов для решения прикладных задач финансовой экономики;
- освоение современных информационных технологий для решения эконометрических задач.

2. Содержание дисциплины:

№ п/п	Наименование разделов / тем дисциплины
1.	Введение в эконометрику.
2.	Эконометрические модели с одним регрессионным уравнением
3.	Системы эконометрических уравнений
4.	Модели временных рядов
Трудоемкость дисциплины составляет 4 з.е / 144 часов.	

Форма контроля – зачет