

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна

Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 01.02.2021 09:58:32

Уникальный программный ключ:

59650034d6e3a6baac49b7bd0f8e79fea1433ff3e82f1fc7e9279a031181baba

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Статистики и эконометрики

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 29 апреля 2020 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.О.28 Эконометрика

Основная профессиональная образовательная программа 39.03.01 Социология программа Экономическая социология

Методический отдел УМУ

« 14 » 04 20 20 г.



Научная библиотека СГЭУ

« 14 » 04 20 20 г.



Рассмотрено к утверждению

на заседании кафедры Статистики и эконометрики
(протокол № 10 от 25.03.2020г.)

Зав. кафедрой  /О.В. Баканач/

Квалификация (степень) выпускника бакалавр

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Эконометрика входит в обязательную часть блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Линейная алгебра, Основы делопроизводства, Математический анализ, Теория вероятностей и математическая статистика

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Эконометрика в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-2 - Способен к социологическому анализу и научному объяснению социальных явлений и процессов на основе научных теорий, концепций, подходов

Планируемые результаты обучения по дисциплине			
Описание ИДК	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
ОПК-2_ИДК1 Способен подготовить сбор социологических данных	ОПК2з1: Методы отбора респондентов и документальных источников для количественных и качественных стратегий сбора информации	ОПК2у1: Работать с технической документацией	ОПК2в1: Способностью формировать задания по реализации проекта выборки при сборе информации
ОПК-2_ИДК2 Способен использовать основные методы социологических исследований для анализа социальных явлений и процессов	ОПК2з2: Основные методы социологических исследований	ОПК2у2: Интерпретировать профессиональные термины и понятия	ОПК2в2: Способностью использовать знания социальных наук применительно к задачам исследования социальных институтов и процессов
ОПК-2_ИДК3 Способен подготовить сбор социологических данных Способен использовать основные методы социологических исследований для анализа социальных явлений и процессов	ОПК2з3: Методы отбора респондентов и документальных источников для количественных и качественных стратегий сбора информации. Основные методы социологических исследований	ОПК2у3: Работать с технической документацией. Интерпретировать профессиональные термины и понятия	ОПК2в3: Способностью формировать задания по реализации проекта выборки при сборе информации. Способностью использовать знания социальных наук применительно к задачам исследования социальных институтов и процессов

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 4
Контактная работа, в том числе:	55.15/1.53
Занятия лекционного типа	18/0.5
Занятия семинарского типа	36/1
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	33.85/0.94
Промежуточная аттестация	19/0.53
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

заочная форма

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 4
Контактная работа, в том числе:	13.15/0.37
Занятия лекционного типа	4/0.11
Занятия семинарского типа	8/0.22
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.15/0
Групповая контактная работа (ГКР)	1/0.03
Самостоятельная работа, в том числе:	92.85/2.58
Промежуточная аттестация	2/0.06
Вид промежуточной аттестации: Зачет	Зач
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	108
Зачетные единицы	3

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Эконометрика представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа			Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе	
		Лекции	Занятия семинарского типа Практ. ич. занятия	ИКР			ГКР
1.	Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	10	18			17	ОПК2_ИДК1 ОПК2_ИДК2 ОПК2_ИДК3
2.	Построение и тестирование различных эконометрических моделей	8	18			16.85	ОПК2_ИДК1 ОПК2_ИДК2 ОПК2_ИДК3
	Контроль	19					

	Итого	18	36	0.15	1	33.85	
--	--------------	-----------	-----------	-------------	----------	--------------	--

заочная форма

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе
		Лекции	Занятия семинарского типа	ИКР	ГКР		
			Практ. ич. занятия				
1.	Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	2	4			46	ОПК2_ИДК1 ОПК2_ИДК2 ОПК2_ИДК3
2.	Построение и тестирование различных эконометрических моделей	2	4			46.85	ОПК2_ИДК1 ОПК2_ИДК2 ОПК2_ИДК3
	Контроль	2					
	Итого	4	8	0.15	1	92.85	

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	лекция	Основные понятия и определения эконометрики.
		лекция	Теоретическая и выборочная ковариация и их свойства.
		лекция	Классическая модель парной регрессии. Нахождение эмпирических коэффициентов регрессии методом наименьших квадратов (МНК).
		лекция	Предпосылки МНК. Теорема Гаусса – Маркова. Стандартные ошибки МНК – оценок коэффициентов регрессии.
		лекция	Проверка гипотез о статистической значимости коэффициента корреляции и эмпирических коэффициентов регрессии. экономический смысл коэффициентов регрессии.
		лекция	Показатели качества регрессии. Проверка гипотезы о качестве модели парной линейной регрессии.
		лекция	Интервальные оценки теоретических коэффициентов регрессии. Предсказание среднего и индивидуального (прогнозного) значений зависимой переменной.
		лекция	Нелинейные модели
2.	Построение и тестирование различных эконометрических мо-	лекция	Линейная модель множественной регрессии
		лекция	Регрессионные модели с переменной

	делей		структурой.
		лекция	Обобщенная эконометрическая модель. Гетероскедастичность и автокорреляция
		лекция	Моделирование одномерных временных рядов
		лекция	Системы одновременных уравнений

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	практическое занятие	Предмет эконометрики. Основные понятия и определения.
		практическое занятие	Теоретическая и выборочная ковариация и их свойства.
		практическое занятие	Линейный коэффициент корреляции, его свойства, проверка значимости
		практическое занятие	Метод наименьших квадратов (МНК). Теорема Гаусса-Маркова.
		практическое занятие	Проверка гипотез о значимости коэффициентов регрессии. Интервальные оценки теоретических коэффициентов регрессии.
		практическое занятие	Показатели качества регрессии.
		практическое занятие	Проверка гипотезы о качестве модели парной линейной регрессии. Прогнозирование значений зависимой переменной.
		практическое занятие	Нелинейные модели
2.	Построение и тестирование различных эконометрических моделей	практическое занятие	Нахождения эмпирических коэффициентов модели множественной линейной регрессии по МНК. Теорема Гаусса – Маркова для модели множественной линейной регрессии.
		практическое занятие	Проверка гипотез о статистической значимости эмпирических коэффициентов регрессии. Интерпретация уравнения множественной линейной регрессии
		практическое занятие	Анализ качества построенного уравнения регрессии. Экономический смысл коэффициента детерминации. Точечный и интервальный прогноз для объясняемой переменной модели
		практическое занятие	Мультиколлинеарность: обнаружение, способы уменьшения (устранения)
		практическое занятие	Применение фиктивных переменных в регрессионных моделях
		практическое занятие	Обнаружение гетероскедастичности и ее устранение. Обобщенный метод наименьших квадратов.
		практическое занятие	Линейные регрессионные модели с

		автокоррелированными остатками.
	практическое занятие	Моделирование одномерных временных рядов
	практическое занятие	Системы одновременных уравнений

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организациями, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - выполнение домашних заданий - тестирование
2.	Построение и тестирование различных эконометрических моделей	- подготовка доклада - подготовка электронной презентации - выполнение домашних заданий - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

1. Кремер, Н. Ш. Эконометрика : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; 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://biblio-online.ru/bcode/426241>
2. 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://biblio-online.ru/bcode/431441>

Дополнительная литература

1. 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://biblio-online.ru/bcode/431441>
2. 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://biblio-online.ru/bcode/434110>
3. Суханова Е. И. Начальный курс эконометрики: руководство к решению задач [Электронный ресурс] : учебное пособие / Л. К. Ширяева. - 3-е изд., испр. и доп. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2017. - 200 с. - ISBN 978-5-94622-771-1.

<http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

4. Эконометрика в табличном редакторе MS EXCEL [Электронный ресурс] : практикум / Е.Г. Репина [и др.]. - Электр. дан. - Самара : Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2019. - 1 электрон. опт. диск. - Систем. требования: процессор Intel с тактовой частотой 1,3 ГГц и выше ; 256 Мб ОЗУ и более ; MS Windows XP/Vista/7/10 ; Adobe Reader ; разрешение экрана 1024?768 ; привод CD-ROM. - Загл. с титул. экрана. - ISBN 978-5-94622-970-8.
<http://lib1.sseu.ru/MegaPro/Web>

Литература для самостоятельного изучения

1. Айвазян С.А. Методы эконометрики: Учебник - М.: Магистр: ИНФРА-М, 2010.
2. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. Прикладная статистика и основы эконометрики: Учебник для вузов. - М.: ЮНИТИ, 2005.
3. Афанасьев В.Н., Юзбашев М.М., Гуляева Т.И. Эконометрика: Учебник. - М.: Финансы и статистика, 2006.
4. Бабешко Л.О. Основы эконометрического моделирования: Учебное пособие. - М.: URSS, 2007.
5. Берндт Э.Р. Практика эконометрики: классика и современность - М.: ЮНИТИ - ДАНА, 2005.
6. Бородич С.А. Эконометрика: Учеб. пособие. – Мн.: Новое знание, 2006.
7. Василенко В.П., Болотин И.Б. Математическое моделирование социально-экономических процессов: Практический курс для студентов специальностей менеджмент организаций и государственное и муниципальное управление. – Смоленск: Изд-во Смол. гос. ун-та, 2008.
8. Колемаев В.А. Математическая экономика: Учебник. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2005.
9. Новиков А.И. Эконометрика: Учеб. пособие. - Электронное издание. М.: ИТК «Дашков и К°», 2013. URL: <http://ibooks.ru/product.php?productid=28880>
10. Репина Е.Г., Суханова Е.И. Практикум по эконометрике: парная регрессия. - Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2014.
11. Репина Е.Г., Ширяева Л.К. Практикум по эконометрике: кейс-задания - Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2014.
12. Суханова Е.И., Ширяева Л.К. Начальный курс эконометрики: руководство к решению задач [Текст]: Учебное пособие / Е. И. Суханова, Л. К. Ширяева. - 2-е изд. перераб. и доп., УМО. - Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2012. - 200с.; 60x84/16. - (Учебная литература для вузов). - Библиогр.: с. 192. - ISBN 978-5-94622-390-4.

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Microsoft Windows 10 Education / Microsoft Windows 7 / Windows Vista Business
2. Office 365 ProPlus, Microsoft Office 2019, Microsoft Office 2016 Professional Plus (Word, Excel, Access, PowerPoint, Outlook, OneNote, Publisher) / Microsoft Office 2007 (Word, Excel, Access, PowerPoint)

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
3. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

5.6 Лаборатории и лабораторное оборудование

Лаборатория информационных технологий в профессиональной деятельности	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ Лабораторное оборудование
---	--

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Эконометрика:

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Оценка докладов	+
	Устный опрос	+
	Тестирование	+
	Практические задачи	-

	Оценка контрольных работ (для заочной формы обучения)	-
Промежуточный контроль	Зачет	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования, утвержденными Ученым советом ФГБОУ ВО СГЭУ №10 от 29.04.2020г.

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-2 - Способен к социологическому анализу и научному объяснению социальных явлений и процессов на основе научных теорий, концепций, подходов

Планируемые результаты обучения по дисциплине				
Описание ИДК	Уровень сформированности	Знать	Уметь	Владеть (иметь навыки)
ОПК-2_ИДК1 Способен подготовить сбор социологических данных	Пороговый	ОПК2з1: Методы отбора респондентов и документальных источников для количественных и качественных стратегий сбора информации	ОПК2у1: Работать с технической документацией	ОПК2в1: Способностью формировать задания по реализации проекта выборки при сборе информации
ОПК-2_ИДК2 Способен использовать основные методы социологических исследований для анализа социальных явлений и процессов	Базовый	ОПК2з2: Основные методы социологических исследований	ОПК2у2: Интерпретировать профессиональные термины и понятия	ОПК2в2: Способностью использовать знания социальных наук применительно к задачам исследования социальных институтов и процессов
ОПК-2_ИДК3 Способен подготовить сбор социологических данных Способен использовать основные методы социологических исследований для анализа социальных явлений и процессов	Повышенный	ОПК2з3: Методы отбора респондентов и документальных источников для количественных и качественных стратегий сбора информации. Основные методы социологических исследований	ОПК2у3: Работать с технической документацией. Интерпретировать профессиональные термины и понятия	ОПК2в3: Способностью формировать задания по реализации проекта выборки при сборе информации. Способностью использовать знания социальных наук применительно к задачам исследования социальных институтов и процессов

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты	Вид контроля/используемые оценочные средства
-------	--	---------------------------------------	--

		таты обучения в соотношении с результатами обучения по программе	Текущий	Промежуточный
1.	Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	ОПК2_ИДК1 ОПК2_ИДК2 ОПК2_ИДК3	Оценка докладов Устный опрос Тестирование	Зачет
2.	Построение и тестирование различных эконометрических моделей	ОПК2_ИДК1 ОПК2_ИДК2 ОПК2_ИДК3	Оценка докладов Устный опрос Тестирование	Зачет

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Примерная тематика докладов

Раздел дисциплины	Темы
Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	<ol style="list-style-type: none"> 1. Нобелевские лауреаты в области эконометрики. 2. Метод максимального правдоподобия и его применения. 3. Различные методы оценки параметров модели парной линейной зависимости. 4. Этапы развития эконометрики 5. Производственная функция и ее применение 6. Непараметрические методы оценки тесноты связи. 7. Кривая Филлипса 8. Тест Бокса – Кокса и его частный случай (тест Пола Зарембки) 9. Примеры различных эконометрических моделей 10. Обзор эконометрических пакетов прикладных программ 11. Показатели точности прогноза 12. Шкала Чеддока для оценки силы связи между переменными
Построение и тестирование различных эконометрических моделей	<ol style="list-style-type: none"> 13. Особенности построения logit и probit моделей. 14. ARCH и GARCH модели и их использование для финансового рынка. 15. Особенности анализа лагированных переменных. 16. Эконометрическое моделирование уровня социальной комфортности проживания населения региона. 17. Различные подходы к выявлению сезонной (циклической) компоненты временного ряда. 18. Различные методы устранения автокорреляции. 19. Различные способы выявления гетероскедастичности. 20. Двухшаговый метод наименьших квадратов при построении системы одновременных уравнений. 21. Проблемы идентификации системы эконометрических уравнений. 22. Прогнозирование социально-эконометрических процессов. 23. Исследование мощности тестов на обнаружение гетероскедастичности. 24. Метод экспоненциального сглаживания. 25. Различные методы выявления тренда временного ряда. 26. Нестационарные временные ряды: особенности исследования. 27. Различные тесты на стационарность временного ряда. 28. Модели авторегрессии и скользящего среднего (ARMA, ARIMA). 29. Коинтеграционный анализ и его применение при исследовании временных рядов. 30. Особенности построения многомерных моделей временных рядов

Вопросы для устного опроса

Раздел дисциплины	Вопросы
Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	<ol style="list-style-type: none">1. Предмет эконометрики. Основные понятия и определения.2. Возникновение и выделение эконометрики в отдельную науку3. Простейшие примеры эконометрических моделей.4. Типы данных в эконометрике5. Виды переменных в эконометрике6. Теоретическая и выборочная ковариация и их свойства.7. Линейный коэффициент корреляции, его свойства.
	<ol style="list-style-type: none">8. Проверка гипотезы о значимости коэффициента корреляции.9. Метод наименьших квадратов (МНК).10. Статистические свойства оценок МНК. Теорема Гаусса-Маркова.11. Проверка гипотез о значимости коэффициентов регрессии.12. Интервальные оценки теоретических коэффициентов регрессии.13. Показатели качества регрессии.14. Коэффициент детерминации и его свойства.15. Проверка гипотезы о качестве модели парной линейной регрессии.16. Прогнозирование значений зависимой переменной.17. Нелинейные модели
Построение и тестирование различных эконометрических моделей	<ol style="list-style-type: none">18. Нахождения эмпирических коэффициентов модели множественной линейной регрессии по МНК. Применение встроенных функций «ЛИНЕЙН» и «РЕГРЕССИЯ» MS Excel для нахождения эмпирических коэффициентов регрессии.19. Теорема Гаусса – Маркова для модели множественной линейной регрессии.20. Интерпретация уравнения множественной линейной регрессии: экономический смысл коэффициентов регрессии.21. Проверка гипотез о статистической значимости эмпирических коэффициентов регрессии.22. Мультиколлинеарность факторных признаков.23. Обнаружение признаков мультиколлинеарности в модели.24. Способы уменьшения (устранения) мультиколлинеарности в модели25. Применение фиктивных переменных в регрессионных моделях26. Обнаружение гетероскедастичности и ее устранение.27. Обобщенный метод наименьших квадратов.28. Линейные регрессионные модели с автокоррелированными остатками.29. Автокорреляция и ее последствия. Обнаружение автокорреляции первого порядка.30. Автокорреляция с лаговой зависимой переменной.31. Моделирование одномерных временных рядов32. Примеры систем одновременных уравнений

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций (min 20, max 50 + ссылку на ЭИОС с тестами)

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций размещены в ЭИОС СГЭУ: <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=514>

Формализация закономерностей общей экономической теории является одним из принципов _____ эконометрической модели.

- верификации
- параметризации
- спецификации
- идентификации

Эконометрическая модель - это математическая модель ...

- гипотетического экономического объекта, построенная на гипотетических данных
- реальной экономической системы (объекта), построенная на статистических данных
- гипотетического экономического объекта, построенная по статистическим данным
- реальной экономической системы (объекта), построенная на гипотетических данных

Объем выборки для построения эконометрической модели ограничен сверху

- числом независимых случайных факторов
- мощностью ЭВМ
- количеством зависимых переменных
- объемом генеральной совокупности

Спецификацией эконометрической модели является ...

- математическая форма записи уравнения зависимости переменной y от одного или нескольких факторов x
- оценка качества построенной эконометрической модели
- прогнозирование значений зависимой переменной y
- расчет оценок параметров эконометрической модели

Проблемой спецификации не является ...

- определение количества независимых переменных x , включаемых в уравнение регрессии
- отбор существенных факторов, оказывающих влияние на зависимую переменную y
- выбор математической формы записи уравнения регрессии
- расчет оценок параметров эконометрической модели

Один из этапов построения эконометрической модели, на котором проверяется качество построенной модели, называется ...

- интерпретацией модели
- спецификацией модели
- верификацией модели
- параметризацией модели

Качество регрессионной модели ухудшается в случае _____ количества оцениваемых параметров при _____ объеме выборки.

- большого ... небольшим
- большого ... достаточно большим
- небольшого ... небольшим
- небольшого ... большим

Пусть истинной моделью является $y = \alpha + \beta_1 x_1 + \beta_2 x_2 + \beta_3 x_3 + \varepsilon$ (x_1, x_2, x_3 - существенные факторы), однако, мы не имеем статистических данных по переменной x_1 . Но другая переменная z выступает идеальным заменителем для нее в том смысле, что имеется строгая (функциональная) линейная связь $x_1 = \lambda_1 + \lambda_2 z$, где λ_1 и λ_2 являются постоянными, но

неизвестными величинами.

Если мы построим регрессию

$\hat{y} = a + cz + b_2 x_2 + b_3 x_3$, то некоторые из оценок коэффициентов b_2 и b_3 могут стать незначимыми

- оценки b_2 и b_3 будут такими же, как и при построении регрессии с использованием x_1
- все оценки коэффициентов b_2 и b_3 станут незначимыми
- оценки b_2 и b_3 изменятся по сравнению с регрессией с использованием x_1

Матрица парных коэффициентов корреляции может служить для решения следующих задач (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных):

- расчета оценок параметров уравнения
- выявления мультиколлинеарных факторов
- определения значимости коэффициента детерминации
- определения тесноты линейной связи между переменными

Взаимодействие мультиколлинеарных факторов эконометрической модели означает, что ... (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных)

- теснота связи между ними превышает по абсолютной величине 0,7
- факторы дублируют влияние друг друга на результат
- влияние одного из факторов на результирующий признак не зависит от значений другого фактора
- факторы не дублируют влияние друг друга на результат

▪ **Для чего строится матрица парных коэффициентов корреляции? (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных)**

- определения коллинеарных факторов
- расчета значений параметров уравнения множественной регрессии
- выявления ложной корреляции
- отбора факторов в модель множественной регрессии

При отборе факторов в модель множественной регрессии проводят анализ ... (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных)

- идентифицируемости системы эконометрических уравнений
- структуры временного ряда
- значений матрицы парных коэффициентов корреляции
- значения скорректированного коэффициента детерминации до и после включения факторов в модель

Из двух мультиколлинеарных факторов из модели множественной регрессии исключается тот, для которого значение коэффициента корреляции с зависимой переменной по абсолютной величине ...

- больше
- стремится к 1
- меньше
- стремится к 0

При построении модели множественной регрессии методом пошагового включения переменных на первом этапе рассматривается...

- модель с одной объясняющей переменной, которая имеет с зависимой переменной наибольший по абсолютной величине коэффициент корреляции
- модель с полным перечнем объясняющих переменных
- модель с несколькими объясняющими переменными, которые имеют с зависимой переменной коэффициенты корреляции по модулю больше 0,5
- модель с одной объясняющей переменной, которая имеет с зависимой переменной наименьший по абсолютной величине коэффициент корреляции

Фиктивная переменная может принимать значения (задание с выбором нескольких пра-

вильных ответов из предложенных):

- 1
- 0
- в интервале от -1 до 1
- 1

Укажите уравнения регрессии, в которых фиктивная переменная D используется только в аддитивной форме (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных):

- $Y=b_0+b_1X+b_2D$
- $Y=b_0+b_1X^2+b_2D$
- $Y=b_0+b_1D+b_2D \cdot X$
- $Y=b_0+b_1X+b_2D+ b_3D \cdot X$

Фиктивными переменными в уравнении множественной регрессии могут быть ... (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных)

- количественные переменные
- переменные, исходные значения которых не имеют количественного значения
- качественные переменные, преобразованные в количественные
- экономические показатели, выраженные в стоимостном измерении

Исследуется зависимость потребления кофе от ряда факторов: x_1 – марки кофе, x_2 – уровня крепости кофе (крепкий, средней крепости, слабой крепости), x_3 – дохода потребителя, x_4 – цены на кофе. Фиктивными переменными в модели не являются (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных)

- x_1
- x_4
- x_3
- x_2

Проводится эконометрическое моделирование зависимости объема продаж компании от ряда факторов: x_1 – цены на товар, x_2 – степени известности торговой марки фирмы, x_3 – дохода потребителя, x_4 – уровня интенсивности рекламной деятельности (высокий уровень – массированная реклама; средний уровень – регулярно повторяющаяся; низкий уровень – время от времени повторяющаяся). Фиктивными переменными в модели не являются (задание с выбором нескольких правильных ответов из предложенных)

- x_1
- x_2
- x_4
- x_3

Модель парной линейной зависимости предложения от цены имеет вид:

$$y = a + bx + \varepsilon.$$

Влияние случайных факторов на величину предложения в этой модели учтено посредством ...

- случайной величины ε
- посредством константы ε
- случайной величины x
- посредством параметра b

В эконометрическую модель множественной регрессии необходимо включить факторы, оказывающие _____ влияние на исследуемый показатель.

- несущественное
- существенное
- детерминированное
- случайное

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме зачета

Раздел дисциплины	Вопросы
Введение в эконометрику. Парный регрессионный анализ	<ol style="list-style-type: none"> 1. Основные этапы эконометрического моделирования. Типы экспериментальных данных. Типы переменных. 2. Типы эконометрических моделей. 3. Виды переменных в эконометрике 4. Ковариация (теоретическая и выборочная), ее свойства. Виды зависимостей. 5. Парный линейный корреляционно-регрессионный анализ. Свойства линейного коэффициента корреляции. 6. Проверка значимости линейного коэффициента корреляции. 7. Предпосылки метода наименьших квадратов. Теорема Гаусса-Маркова 8. Стандартные ошибки МНК – оценок коэффициентов регрессии. 9. Проверка гипотез о статистической значимости коэффициента корреляции и эмпирических коэффициентов регрессии. 10. Показатели качества регрессии 11. Доверительные интервалы для параметров парной регрессии 12. Оценка значимости уравнения парной регрессии. 13. Коэффициент детерминации, его свойства и экономический
Построение и тестирование различных эконометрических моделей	<p style="text-align: center;">смысл</p> <ol style="list-style-type: none"> 14. Нелинейная регрессия. 15. Корреляция для нелинейной регрессии 16. Спецификация модели множественной регрессии 17. Оценка параметров модели множественной регрессии МНК. Вектор оценок параметров. 18. Предпосылки метода наименьших квадратов для множественного регрессионного анализа 19. Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии 20. Мультиколлинеарность. Методы устранения мультиколлинеарности 21. Оценка значимости уравнения множественной регрессии. Скорректированный коэффициент детерминации 22. Модели с переменной структурой. Фиктивные переменные 23. Гетероскедастичность остатков модели. Методы обнаружения гетероскедастичности 24. Гетероскедастичность остатков модели. Методы устранения гетероскедастичности 25. Автокорреляция остатков модели. Методы обнаружения автокорреляции. Статистика Дарбина-Уотсона. Коэффициенты автокорреляции. 26. Автокорреляция остатков модели. Методы устранения автокорреляции. 27. Моделирование временных рядов: основные понятия. 28. Основные типы уравнения трендов. Линейный тренд, его свойства 29. Типы сезонных колебаний 30. Моделирование сезонных колебаний 31. Основные предпосылки систем взаимосвязанных переменных. Структурная и приведенная формы модели 16. Использование косвенного, двухшагового и трехшагового МНК в оценке параметров систем линейных одновременных уравнений

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 2-х балльной системы
«зачтено»	ОПК2_ИДК1
«не зачтено»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне