

2013

Министерство образования и науки Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Владимирский государственный университет
имени Александра Григорьевича и Николая Григорьевича Столетовых»
(ВлГУ)



УТВЕРЖДАЮ
Проректор
по учебно-методической работе
_____ А.А.Панфилов
« 08 » 12 2015
г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
СТАТИСТИЧЕСКОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ И ПРОГНОЗИРОВАНИЕ
(наименование дисциплины)

Направление подготовки 38.03.01 «Экономика»
Профиль подготовки «Экономика предприятий и организаций»
Уровень высшего образования Бакалавриат
Форма обучения Очная

Семестр	Трудоемкость зач. ед./ час.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежуточног о контроля (экз./зачет)
5	2, 72	18	18		36	Зачет
Итого	2, 72	18	18		36	Зачет

Владимир 2015

mas

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Статистическое моделирование и прогнозирование» является формирование умений и навыков составления прогнозов и использования статистических моделей в экономической практике.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина «Статистическое моделирование и прогнозирование» относится к обязательным дисциплинам вариативной части ОПОП.

Необходимыми условиями для освоения дисциплины являются: знание математического аппарата и основных экономических категорий, владение компьютерными методами обработки и анализа данных, графического и табличного представления информации.

Содержание дисциплины является логическим продолжением содержания дисциплин «Статистика», «Эконометрика», «Информатика», Теория вероятностей и математическая статистика», «Методы оптимальных решений», «Микроэкономика», и «Макроэкономика».

В свою очередь, знание предмета «Статистическое моделирование и прогнозирование» является необходимым базисом для изучения таких дисциплин как «Теория отраслевых рынков», «Экономика инноваций», «Экономика малого и среднего бизнеса» в части выявления тенденций и составления прогнозов показателей, применения статистических методов для анализа и выявления закономерностей внутренней и внешней среды.

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы следующие компетенции:

способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач (ОПК-2);

способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы (ОПК – 3).

В результате освоения дисциплины обучающийся должен демонстрировать следующие результаты образования:

знать:

методы выявления тенденций, сглаживания рядов динамики, показатели точности и адекватности прогнозной модели, метод многофакторного анализа. (ОПК-2), (ОПК-3);

уметь

выделять трендовую, и сезонную составляющие ряда динамики, рассчитывать прогнозное значение и интерпретировать полученные данные, применять методы работы со статистическими данными в соответствии с конкретными условиями и целями; проводить статистические наблюдения, (ОПК-2), (ОПК-3) ;

владеть

навыками использования электронных таблиц Excel для первичной обработки и анализа статистических данных на основе сводки и группировки, графического и табличного представления статистической информации (ОПК-2), (ОПК-3).

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Общая трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетных единиц, 72 часов.

№ п/п	Раздел (тема) дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)							Объем учебной работы, с применением интерактивных методов (в часах / %)	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра), форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Семинары	Практические занятия	Лабораторные работы	Контрольные работы,	СРС	КП / КР		
1	Место и роль моделирования и прогнозирования в управлении предприятием. Основные понятия.	5	1	1		1			2		-	
2	Подготовка исходной информации для прогнозирования.	5	1	1		1			2		2/100	
3	Методы проверки гипотезы о наличии тренда	5	3	2		2			2		2/50	
4	Методы сглаживания рядов динамики	5	5	2		2			2		2/50	Рейтинг-контроль 1
5	Сглаживание по теоретической кривой	5	7	2		2			4		2/50	
6	Расчет точечного прогноза	5	9	1		1			2		1/50	
7	Выделение циклической и сезонной составляющей	5	9-11	2		2			4		2/50	Рейтинг-контроль 2
8	Оценка точности и адекватности моделей	5	11-13	2		2			4		2/50	
9	Понятие адаптивных моделей	5	13	1		1			4		1/50	
10	Условия применения регрессионных моделей	5	15	2		2			6		2/50	
11	Использование моделей многомерного анализа для экономических исследований	5	17	2		2			4		4/100	Рейтинг-контроль 3
	Всего			18		18			36		20/55,6	Зачет

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению 38.03.01 «Экономика» реализация компетентного подхода с целью формирования и развития профессиональных навыков обучающихся предусматривает использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий:

— для лекционных занятий - опережающее изучение материала с последующим обсуждением, то есть изучение обучающимися нового материала до его изучения в ходе

аудиторных занятий. Необходимо самостоятельно заранее, то есть дома, до аудиторных занятий, изучить учебную литературу, нормативные акты, продумать вопросы по соответствующей теме и дать краткие ответы на все проблемные вопросы соответствующей темы.

для практических занятий –

ситуационный анализ Темы 2-10), в ходе которого совместными усилиями группы студентов необходимо проанализировать ситуацию, возникающую при конкретном положении дел, и выработать практическое решение; окончание процесса – оценка предложенных алгоритмов и выбор лучшего в контексте поставленной проблемы

компьютерные симуляции (Тема 11), предусматривающие принятие решения на основе прогнозной ситуации, смоделированной с помощью компьютера.

Удельный вес занятий, проводимых в интерактивной форме в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта составляет не менее 30% аудиторных занятий, занятия лекционного типа не превышают 50% от общей величины аудиторных занятий.

6. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ИТОГАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ И УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ

Контроль освоения дисциплины производится в соответствии с положением о рейтинговой системе комплексной оценки знаний студентов ФГБОУ ВО ВлГУ.

Текущий контроль проходит в форме рейтинг-контроля.

Промежуточная аттестация по итогам освоения дисциплины «Статистическое моделирование и прогнозирование» направлена на закрепление основных элементов теоретического и практического курса. Промежуточная аттестация проходит в форме зачета, который включает в себя ответы на теоретические вопросы.

Пример заданий на рейтинг-контроль

Рейтинг 1

Задание 1

По представленным данным проверить гипотезу о наличии тенденции методом «восходящих и нисходящих серий»

	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014
Численность населения в РФ, млн. человек	146,3	145,2	145,0	144,3	143,8	143,2	142,8	142,8	142,7	142,9	142,9	143,0	143,3	143,7

Задание 2

С помощью трехзвенной простой скользящей средней определить сглаженное значение уровня ряда для 2009 года.

Задание 3

Восстановить сглаженное значение с помощью пятизвенной простой скользящей для 2014 года.

Задание 4

Определить сглаженное значение уровня ряда для 2001 года с помощью четырехзвенной простой скользящей средней.

Задание 5

Сгладить линию тренда методом выравнивания по прямой и рассчитать точечный прогноз на период упреждения, равный двум годам.

Рейтинг 2

Задание 1

По данным, приведенным в таблице, составить уравнение линии тренда

Задание 2

Рассчитать индексы сезонности с учетом линии тренда

Задание 3

Скорректировать линию тренда на индексы сезонности

Задание 4

Дать оценку точности модели

Рейтинг 3

По данным сборника Росстата РФ «Статистика регионов» провести кластеризацию регионов РФ по показателям: валового регионального дохода на душу населения, среднедушевым денежным доходам на душу населения, потребляемой электроэнергии на душу населения. Обосновать выделенные кластеры.

Вопросы к зачету

Средние цены на рынке жилья за 1 кв. метр общей площади на первичном рынке типовых квартир в регионе, руб.						
	1	2	3	4	5	6
I квартал	25038,35	29750,73	50201,51	60467,73	64135,25	68087,04
II квартал	25224,69	35909,1	51597,68	63723,12	63111,51	66596,65
III квартал	25833,08	40288,91	52065,36	65685,99	59795,9	65348,68
IV квартал	28290,58	42529,06	54304,24	67867,2	59596,52	64588,13

Прогнозирование

1. Виды прогнозов. Прогнозирование
2. Проверка гипотезы о наличии тенденции. Метод восходящих и нисходящих серий.
3. Проверка гипотезы о наличии тенденции. Метод выявления тренда с использованием медианы.
4. Проверка гипотезы о наличии тенденции. Метод Фостера-Стюарта
5. Выравнивание ряда динамики с помощью простой скользящей средней.
6. Выравнивание ряда динамики с помощью взвешенной скользящей средней.
7. Выравнивание ряда динамики с помощью теоретической прямой.
8. Восстановление недостающих значений ряда динамики.
9. Методы выбора теоретической кривой.
10. Расчет прогнозного значения на основе теоретической прямой.
11. Расчет точечного прогноза на основе среднего абсолютного прироста.
12. Расчет точечного прогноза на основе среднего темпа роста.
13. Оценка точности модели на основе среднеквадратической ошибки.
14. Расчет индексов сезонности при отсутствии тренда
15. Расчет индексов сезонности при наличии тренда
16. Метод наименьших квадратов
17. Понятие адаптивных моделей
18. Выравнивание на основе экспоненциальной модели

Ряды динамики

19. Виды рядов динамики.
20. Составляющие уровня ряда динамики.
21. Расчет среднего уровня ряда динамики.
22. Расчет дополнительных характеристик рядов динамики: темп роста, темп прироста, абсолютного прироста, абсолютного значения одного процента прироста
23. Расчет среднего абсолютного прироста и среднего темпа роста.

Моделирование .

24. Понятие моделирования. Виды моделей

25. Основные задачи и условия применения корреляционно-регрессионного анализа и моделирования.
26. Измерение тесноты связи в парной корреляционной модели
27. Показатели тесноты связи в многофакторной корреляционной модели
28. Парная регрессия
29. Множественная регрессия
30. Модели многомерного анализа
- 31.33 Содержание и сфера применения кластерного анализа
32. Содержанием и применение таксонометрического метода анализа
33. Содержание и применение метода главных компонент

Самостоятельная работа студентов

Самостоятельная работа выполняется в форме исследовательской работы, осуществляемой малыми группами 3-5 человек. Контроль за выполнением самостоятельной работы осуществляется в ходе всего семестра. Результаты оформляются в виде доклада с презентацией, которые заслушиваются на последних занятиях. Лучшие работы оформляются в виде статей с последующей публикацией и докладываются на конференциях. Это позволит развить навыки работы учащихся в коллективе, командный подход к самостоятельному решению нестандартных дополнительных задач или проблем.

Тема может быть скорректирована по согласованию с преподавателем.

Перечень тем самостоятельных работ

1. Проблемы оценки средних характеристик для рядов динамики с нелинейным характером профиля.
2. Имитационное моделирование в экономике
3. Статистическое моделирование в экономике.
4. Метод Монте-Карло
5. Использование имитационного моделирования для обучения.
6. Адаптивные модели и их применение в экономике
7. Особенности экономического анализа с помощью кластерного метода.
8. Особенности экономического анализа с помощью метода главных компонент.
9. Особенности многомерного анализа на основе таксонометрической модели.
10. Анализ теоретических кривых и сфера их применения в экономических расчетах.
11. Значение и содержание моделей межотраслевого баланса В.В. Леонтьева
12. Использование модели «расстояний» для ранжирования регионов на основе качественных и количественных признаков.
13. Модели бальной оценки качественных параметров: содержание, сфера и особенности применения.
14. Метод наименьших квадратов: содержание: особенности применения и значение для экономических расчетов

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

а) основная литература:

1. Прогнозирование и планирование в условиях рынка: Учебное пособие / Л.Е. Басовский. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 260 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат). (переплет) ISBN 978-5-16-004198-8, 500 экз
<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=437290>
2. Моделирование социальных явлений и процессов с примен. матем. методов: Учеб. пос. / Г.В. Осипов и др.; Под общ. ред. В.А. Садовниченко - М.: Норма: НИЦ ИНФРА-М, 2014 - 192 с.: ил.; 60х90 1/16 - (Соц. науки и матем.). (п) ISBN 978-5-91768-533-5, 200 экз
<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=474623>
3. Прогнозирование и планирование в условиях рынка: Учебное пособие / Т.Н. Бабич и др. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 336 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат). (переплет) ISBN 978-5-16-004577-1, 500 экз
<http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=454207>

4. Статистическая методология в системе научных методов финан. и эконом. исслед.: Учеб. / В.Н.Едронова, А.О.Овчаров; Под ред. В.Н.Едроновой - М.: Магистр: НИЦ ИНФРА-М, 2013. - 464 с.: 60х90 1/16. - (Магистратура). (п) ISBN 978-5-9776-0283-9, 500 экз <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=418044>

б) дополнительная литература:

5. Статистический анализ данных, моделирование и исследование вероятностных закономерностей. Компьютерный подход / Б.Ю. Лемешко, С.Б. Лемешко, С.Н. Постовалов и др. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 890 с.: 60х90 1/16 ISBN 978-5-16-103267-1 (online) <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=515227>

6. Учебное пособие / А.Ю. Козлов, В.С. Мхитарян, В.Ф. Шишов. - М.: ИНФРА-М, 2014. - 320 с.: 60х90 1/16. - (Высшее образование). (переплет) ISBN 978-5-16-004579-5 <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=429722>

7. Основы статистического анализа. Практ. по стат. мет. и исслед. операций с исп. пакетов STATISTICA и EXCEL: Уч. пос. / Э.А. Вуколов - 2 изд., испр. и доп. - М.: Форум: НИЦ Инфра-М, 2013. - 464 с.: 70х100 1/16. - (ВО). (п) ISBN 978-5-91134-231-9, 500 экз. <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=369689>

8. Кундышева, Е. С. Экономико-математическое моделирование [Электронный ресурс] : Учебник / Е. С. Кундышева; под науч. ред. проф. Б. А. Сулакова. — 4-е изд. — М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2012. — 424 с. - ISBN 978-5-394-01716-2 <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=511969>

в) периодические издания:

журнал «Вопросы статистики»

г) интернет-ресурсы:

1) Каталог публикаций: Федеральная служба государственной статистики www.gks.ru/wps/wcm/connect/rosstat_main/rosstat/ru/.../catalog/

2) Статистические сборники ВШЭ — Национальный ... <https://www.hse.ru/primarydata/>

3) Электронные версии публикаций: Владимирстат vladimirstat.gks.ru/wps/wcm/...ts/vladimirstat/.../electronic_versions/

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Материально-техническим обеспечением дисциплины является:

для лекционных занятий:

1. Лекционная аудитория, оснащенная оборудованием: проектор мультимедийный Epson “EB-W18”, экран Lumien, доска настенная.
2. комплект электронных презентаций/слайдов

для практических занятий:

1. Компьютерный класс, оснащенный оборудованием: 13 персональных компьютеров в составе ThinkCentre M70e/keyb/mouse/L1900p19”, на которых установлено лицензионное программное обеспечение (Microsoft office, Statistica), обеспечен доступ к образовательному серверу ВлГУ, Интернет, проектор BenQ MX 660 P DLP 3000ANSI в комплекте экран настенный рулонный SimScreen 200*200 Matte White S, доска настенная;
2. пакеты ПО общего назначения (текстовые редакторы, графические редакторы)

Рабочая программа дисциплины составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО
по направлению 38.03.01 Экономика

Рабочую программу составил Марченко Е.М.



(ФИО, подпись)

Рецензент

(представитель работодателя) Л.В.Павлов

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры ЭУИИ

Протокол № 12 от 07.12.15 года

Заведующий кафедрой О.А.Доничев

(ФИО, подпись)

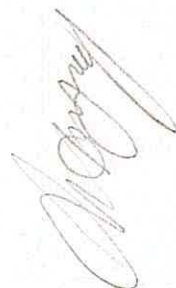
Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии
направления

экономика

Протокол № 3 от 8.12.15 года

Председатель комиссии П.Н.Захаров

(ФИО, подпись)



**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

Рабочая программа одобрена на 16/17 учебный год

Протокол заседания кафедры № 1 от 31.08.16 года

Заведующий кафедрой _____ О.А.Доничев



Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____ О.А.Доничев

Рабочая программа одобрена на _____ учебный год

Протокол заседания кафедры № _____ от _____ года

Заведующий кафедрой _____ О.А.Доничев