

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 образовательной  
 деятельности

А.А. Панфилов

« 29 » 08 2017 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Эконометрика**

(наименование дисциплины)

Направление подготовки 38.03.01 Экономика

Профиль/программа подготовки Экономика предприятий и организаций

Уровень высшего образования бакалавриат

Форма обучения заочная

Семестр	Трудоемкость зач. ед./ час.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежуточного контроля (экз./зачет)
5	4/144	6	8		130	Зачет
<b>Итого</b>	4/144	6	8		130	Зачет

## 1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель освоения дисциплины (модуля) «Эконометрика» является:

1. Формирование у студентов системного представления об эконометрике, как науке, исследующей данные статистики для изучения поведения, описания и прогнозирования развития экономической деятельности;
2. Приобретение практических навыков в построении эконометрических моделей, принятии решений о спецификации и идентификации модели и выборе метода оценки параметров модели, интерпретации результатов, получении прогнозных оценок на основе анализа эконометрических данных;
3. Приобретение умений использовать современные эконометрические пакеты прикладных программ.

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОПОП ВО

Дисциплина «Эконометрика» относится к базовой части учебного плана ОПОП бакалавриата по направлению 38.03.01 Экономика.

Дисциплина входит в блок Б1.Б 12 учебного плана подготовки бакалавриата направления «Экономика».

Для изучения дисциплины студенты могут использовать знания, полученные при освоении курсов: «Линейная алгебра», «Математический анализ», «Статистика», «Микроэкономика», «Макроэкономика».

Учебная дисциплина «Эконометрика» является теоретическим и методологическим основанием для изучения других дисциплин: «Моделирование бизнес-процессов», «Общая теория систем», «Бизнес-прогнозирование» и др.

Знания, полученные в рамках изучения дисциплины, могут быть применены при прохождении практики, выполнении научно-исследовательских работ, подготовке к ВКР (выпускной квалификационной работы).

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

Процесс изучения дисциплины «Эконометрика» направлен на формирование следующих общекультурных и профессиональных компетенций:

- 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).

#### 4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетные единицы, 144 часа.

№ 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 и (по неделям семестра) Форма промежуточной аттестации (по семестрам)	
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	Контрольные работы	СРС	КП / КР			
1	Предмет, метод и задачи дисциплины «Эконометрика»	5			1				10		1/100	
2	Линейные однофакторные регрессионные модели	5		1	1				20		2/100	
3	Эконометрические модели множественной регрессии	5		1	1				20		2/100	
4	Нелинейные модели и их линеаризация	5		1	1				20		2/100	
5	Оценка качества эконометрических регрессионных моделей и прогнозирование на их основе	5		1	1				20		2/100	
6	Временные ряды	5		1	2				20		2/100	
7	Системы эконометрических уравнений	5		1	1				20		2/100	Зачет
<b>Всего: 144ч.</b>				<b>6</b>	<b>8</b>				<b>130</b>		<b>14/100</b>	<b>Зачет</b>

#### 5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика» компетентностный подход к изучению дисциплины «Эконометрика» реализуется путём проведения лекционных и практических занятий с применением



мультимедийных технологий. Преподавание дисциплины ведется с применением следующих видов образовательных технологий:

- информационные технологии;
- работа в команде (малой группе);
- разрешение проблем;
- проблемное обучение;
- индивидуальное обучение;
- междисциплинарное обучение.

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

Текущий контроль знаний студентов производится в дискретные временные интервалы преподавателем, ведущим лекционные и практические занятия по дисциплине, в следующих формах:

- тестирование;
- дискуссии.

Промежуточная аттестация знаний студентов производится по результатам работы в 5-ом семестре в форме зачета, который включает в себя ответы на теоретические вопросы.

Фонды оценочных средств, включающие типовые задания и методы контроля, позволяющие оценить знания по данной дисциплине, включены в состав УМКД.

### **Перечень практических задач**

1. Исследуется зависимость затрат на рекламу  $y$  от годового оборота  $x$  в некоторой отрасли. Для этого собрана информация по 20 случайно выбранным предприятиям этой отрасли:  $\sum x = 17,3$ ;  $\sum y = 1,2$ ;  $\sum xy = 944,3$ ;  $\sum x^2 = 9250$ ;  $\sum y^2 = 127,2$ . Предполагается, что зависимость  $y$  от  $x$  описывается уравнением  $y = a + bx$ . Оценить параметры регрессии с помощью метода наименьших квадратов.
2. Зависимость расходов населения на продукты питания ( $y$ , тыс. руб.) от уровня доходов семьи ( $x$ , тыс. руб.) имеет вид  $y = 0,7 + 0,2x$ . Что показывает величина коэффициента регрессии?
3. Зависимость начального уровня заработной платы сотрудников коммерческого банка ( $S$  – начальная годовая заработная плата в долларах) от уровня образования

(продолжительности обучения,  $N$  – число лет обучения) имеет вид  $S = -1516 + 50N$ . Что означает оценка свободного члена в данном уравнении регрессии?

4. Уравнение парной регрессии имеет вид  $y = 2 + 3x$ , если фактор равен 5, то чему равен признак?
5. Даны две регрессии, рассчитанные по 25 годовым наблюдениям: а)  $y_t = -30 + 0,18x_t$  ( $y_t$  – расходы на оплату жилья,  $x_t$  – доход); б)  $y_t = 50 + 4,5t$  ( $y_t$  – расходы на оплату жилья,  $t$  – время). Дайте экономическую интерпретацию построенных регрессий. Согласуются ли они друг с другом?
6. Торговое предприятие имеет сеть, состоящую из 12 магазинов, информация о деятельности, которых представлена в таблице.

№ магазина	Годовой товарооборот, млн.руб.	Торговая площадь, тыс.м <sup>2</sup>	Среднее число посетителей в день, тыс.чел.
1	19,76	0,24	8,25
2	38,09	0,31	10,24
3	40,95	0,55	9,31
4	41,08	0,48	11,01
5	56,29	0,78	8,54
6	68,51	0,98	7,51
7	75,01	0,94	12,36
8	89,05	1,21	10,81
9	91,13	1,29	9,89
10	91,26	1,12	13,72
11	99,84	1,29	12,27
12	108,55	1,49	13,92

Требуется: построить диаграммы рассеяния годового товарооборота ( $y$ ) в зависимости от торговой площади ( $x_1$ ) и среднего числа посетителей в день ( $x_2$ ); определить форму связи и уравнение связи между результатом и каждым из факторов.

7. Перейти от уравнения регрессии в натуральном масштабе переменных, описывающей зависимость среднедневного душевого дохода ( $y$ , руб.) от среднедневной заработной платы одного работающего ( $x_1$ , руб.) и среднего возраста безработного ( $x_2$ , лет)  $y = 337,373 + 1,966x_1 - 12,0867x_2$  к уравнению регрессии в стандартизованном масштабе переменных, если известно, что  $61,44 \sigma_y =$ ,  $125,86 \sigma_{x_1} =$ ,  $20,58 \sigma_{x_2} =$  и интерпретировать коэффициенты уравнения регрессии.
8. На основании информации построено двухфакторное уравнение годового товарооборота в зависимости от торговой площади магазина ( $x_1$ ) и среднего числа посетителей в день ( $x_2$ ),



которое выглядит следующим образом:  $y = -10.8153 + 61.6583x_1 + 2.2748x_2$ . Дайте экономическую интерпретацию коэффициентов уравнения регрессии.

9. Дэвид Ромер, исследуя факторы, влияющие на академическую успеваемость студентов, построил следующую эконометрическую модель  $G_i = 1.07 + 1.74ATT_i + 0.6PS_i$ ,  $n=195$ , где  $G_i$  – оценка (A – 4, B – 3, C – 2, F – 1, что соответствует российским оценкам от 5 до 2), полученная студентом класса Ромера на экзамене,  $ATT_i$  – доля лекций, посещенных данным студентом,  $PS_i$  – доля выполненных им домашних заданий. Задание: 1) Дайте интерпретацию коэффициентам регрессии. 2) Предположим, что лекции по курсу Ромера занимают 25 часов, а выполнение всех домашних заданий – 50 часов. Если у студента появился лишний час, который он может посвятить учебе, следует ли ему с целью повышения будущей оценки пойти на лекцию, или лучше остаться дома и заниматься домашними заданиями? 3) Как бы изменились ваши рекомендации, если бы структура курса была иной: 50 часов лекций и 10 часов на выполнение домашних заданий?

10. По 20 предприятиям региона изучается зависимость выработки продукции на одного работника  $y$  (тыс.руб.) от ввода в действие новых основных фондов  $x_1$  (% от стоимости фондов на конец года) и от удельного веса рабочих высокой квалификации в общей численности рабочих  $x_2$  (%).  $y = -1.8353 + 0.9459x_1 + 0.0856x_2$ , где  $y = 9.6$ ;  $1 x = 6.19$ ;  $2 x = 22.3$ . Задание: 1) Определить с помощью коэффициентов эластичности силу влияния каждого фактора на результат. 2) Ранжировать факторы по силе влияния.

11. Линеаризовать функцию  $y = ax^2$  в точке  $x_0, y_0$ .

$$z = ayx - b \frac{x}{y} \text{ в точке } x_0, y_0.$$

12. Линеаризовать уравнение

$$\frac{dx}{dt} = 5 \frac{dy}{dt} + y.$$

13. Линеаризация нелинейного ДУ.  $3xy - 4x^2 + 1.5$

14. Линеаризовать уравнение состояния  $x' = -x^2$ ,  $x, x' \in \mathbb{R}$ .

15. По 20 предприятиям легкой промышленности получена следующая информация, характеризующая зависимость объема выпуска продукции  $y$  (млн. руб.) от количества отработанных за год человеком часов  $x_1$  (тыс. чел./час) и среднегодовой стоимости производственного оборудования  $x_2$  (млн. руб.):

Уравнение регрессии  $y = 35 + 0.06x_1 + 2.5x_2$

Множественный коэффициент корреляции 0.9

Сумма квадратов отклонений расчетных значений результата от фактических 3000

Задание: 1) Определите коэффициент детерминации в этой модели. 2) Составьте таблицу дисперсионного анализа.

16. Предположим, что модель урожайности пшеницы  $y$  (ц/га) от количества внесенных минеральных удобрений на 1 га  $x_1$  (ц) и осадков  $x_2$  (мм) характеризуется следующим уравнением:  $y = -120 + 0,2x_1 - 0,008x_1^2 + 0,8x_2 - 0,001x_2^2 + \varepsilon$ . При этом  $\sigma_y = 2$ ;  $n = 30$ ;  $R = 0,85$ . Составить таблицу дисперсионного анализа для проверки при уровне значимости  $\alpha = 0,05$  статистической значимости уравнения множественной регрессии и его показателя тесноты связи.
17. По 30 предприятиям отрасли были получены следующие результаты регрессионного анализа (таблица) зависимости объема численности занятых на предприятии  $x_1$  (чел) и среднегодовой стоимости основных фондов  $x_2$  (млн. руб.):  
Множественный коэффициент корреляции 0,85  
Уравнение регрессии  $y = ??? + 0,48x_1 + 20x_2$ ,  
Стандартные ошибки параметров (2) (0,06) (???)  
 $t$  – значение (1,5) (???) (4) 41
- Задание: 1) Восстановите пропущенные характеристики. 2) С вероятностью 90%, 95% и 99% постройте доверительный интервал для коэффициентов регрессии.
18. По данным полученным от 20 фермерских хозяйств одного из регионов, изучается зависимость объема выпуска продукции растениеводства  $y$  (млн. руб.) от трех факторов: численности работников  $x_1$ , количества минеральных удобрений  $x_2$  (кг) и количества осадков в период вегетации  $x_3$  (г). Были получены следующие результаты:  
 $R^2 = 0,75$   
Уравнение регрессии  $y = -5 + 0,8x_1 + 1,2x_2$   
95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_1$  нижняя (0,4) верхняя (???)  
95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_2$  нижняя (???) верхняя (1,4)  
 $R^2 = 0,77$   
Уравнение регрессии  $y = 2 + 0,5x_1 + 1,7x_2 - 2x_3$   
95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_1$  нижняя (0,1) верхняя (???)  
95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_2$  нижняя (???) верхняя (2,3)  
95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_3$  нижняя (???) верхняя (1,5)



Задание: 1) Восстановите пропущенные границы доверительных интервалов в каждом уравнении. 2) Выберите наилучшее уравнение регрессии. Дайте интерпретацию их параметров и доверительных интервалов для коэффициентов регрессии.

19. Регрессия зависимой переменной  $y$  на три независимые переменные на основе  $n=30$  наблюдений дала следующие результаты:

$$\text{Уравнение регрессии } y = 25,1 + 1,2x_1 + x_2 - 0,5x_3$$

Стандартные ошибки (2,1) (1,5) (1,3) (0,06)

t-значение (11,9) ( ) ( ) ( )

95% - доверительные границы ( $\pm 4,3$ ) ( ) ( ) ( )

Заполните пропуски.

20. По 40 предприятиям одной отрасли исследовалась значимость производительности труда –  $y$  от уровня квалификации рабочих –  $x_1$  и энерговооруженности их труда –  $x_2$ . Результаты оказались следующими:

Множественный коэффициент корреляции 0,85

$$\text{Уравнение регрессии } y = a + 10x_1 + 2x_2,$$

Стандартные ошибки параметров (0,5) (2) (???)

t-критерий (3) (???) (5)

Задание: 1) Определите параметр  $a$  и заполните пропущенные значения. 2) Оцените значимость уравнения в целом.

21. По 50 семьям изучалось потребление мяса –  $y$  (кг на душу населения) от дохода –  $x_1$  (руб. на одного члена семьи) и от потребления рыбы –  $x_2$  (кг на душу населения). Результаты оказались следующими:

Множественный коэффициент корреляции 0,85

$$\text{Уравнение регрессии } y = -180 + 0,2x_1 - 0,4x_2,$$

Стандартные ошибки параметров (20) (0,01) (0,25)

Задание: 1) Оцените значимость параметров уравнения. 2) Рассчитайте F-критерий Фишера.

22. По данным, полученным от 20 фермерских хозяйств одного из регионов, изучается зависимость объема выпуска продукции растениеводства  $y$  (млн. руб.) от четырех факторов: численности работников  $x_1$  (чел.), количества минеральных удобрений на 1 га посева  $x_2$  (кг), количества осадков в период вегетации  $x_3$  (г) и качества почвы  $x_4$  (баллов). Были получены следующие варианты уравнений регрессии и доверительные интервалы коэффициентов регрессий:

$$R \geq 0,77$$

$$\text{уравнение регрессии } y = 2 + 0,5x_1 + 1,7x_2 - 2x_3$$



95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_1$  нижняя (???)  
верхняя (0.8)

95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_2$  нижняя (1,3)  
верхняя (???)

95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_3$  нижняя (-2,2)  
верхняя (???)

R 2 0.81

уравнение регрессии  $y = 6,4 + 0,7x_1 + 1,5x_2 - 2x_3 + 0,8x_4$

95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_1$  нижняя (0,3)  
верхняя (???)

95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_2$  нижняя (-0,2)  
верхняя (???)

95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_3$  нижняя (???)  
верхняя (-1,2)

95% доверительный интервал для коэффициента регрессии при факторе  $x_4$  нижняя (???)  
верхняя (1,2)

Задание: 1) Восстановите пропущенные границы доверительных интервалов в каждом уравнении. 2) Выберите наилучшее уравнение регрессии. Дайте интерпретацию их параметров и доверительных интервалов для коэффициентов регрессии.

23. По ежегодным данным с 2000 по 2010 год (всего 11 наблюдений) оценивается тренд туристического потока из России в Финляндию с помощью уравнения регрессии  $Tripst_t = \beta_0 + \beta_1 t + \epsilon_t$ . Здесь  $t$  – год, которому соответствует наблюдение ( $t=0$  для 2000 года,  $t=10$  для 2010 года), а  $Tripst_t$  – число туристических поездок (в тысячах) российских граждан в Финляндию в году  $t$ . Вот результаты оценивания:  $\hat{\beta}_0 = 2$  (51.1) (8.6) 278.8 40.4,  $\hat{\beta}_1 = 0.7$ , 253000  $Tripst_t$   
 $R^2 = 0.7$ ,  $TSS = 253000$ . В скобках под оценками коэффициентов приведены их стандартные ошибки. а) Согласно оценённой модели, насколько в среднем увеличивается поток туристов из России в Финляндию за два года? б) Постройте 90% доверительный интервал для коэффициента  $\beta_1$ . в) Оцените дисперсию случайной составляющей  $\epsilon_t$ .
24. По ежегодным данным за 1975-1988 гг. (14 наблюдений) оценивалась зависимость цены на бензин (Petrol, центы за галлон) от цены на сырую нефть (Oil, доллары за баррель). Результаты оценивания приведены ниже: (4.6) (0.2) и 41.9 3.0  $P_i = \beta_0 + \beta_1 Oil_i + \epsilon_i$ . В скобках под оценками коэффициентов приведены их стандартные ошибки. Также известно, что  $RSS = 631.1$ , а  $TSS = 12622$ . Предполагается, что все предпосылки классической линейной нормальной регрессионной модели выполнены. а) Рассчитайте коэффициент детерминации  $R^2$ . б) Проверьте гипотезу о том, что рост цены на нефть на 1 долл. за баррель приводит к

росту цены на бензин на 2 цента за галлон, используя уровень значимости 10%. в) В 1988 году цена на нефть составила 12.57 доллара за баррель. Какова была ожидаемая (прогнозируемая согласно имеющейся модели регрессии) цена на бензин? Какой должна быть цена на нефть, чтобы ожидаемая цена на бензин составила 100 центов за галлон?

25. Пусть имеется следующий временный ряд:

$$t: 1 \quad 2 \quad 3 \dots 9$$

$$y_t: 25 \dots \dots \dots 10$$

Известно также, что  $\sum y_t = 130$ ;  $\sum y_t^2 = 3100$ ;  $\sum_{t=2}^n y_t y_{t-1} = 2552$ .

Определить для этого временного ряда значение коэффициента автокорреляции первого порядка.

26. На основе квартальных данных объемов продаж предприятия за 2008-2014 гг. была построена аддитивная модель временного ряда, трендовая компонента которой имеет вид:

$$T = 200 + 3 \cdot t \quad (t = 1, 2, \dots)$$

Показатели за 2013 г. приведены в таблице:

Квартал	Фактический объем продаж	Компонента аддитивной модели		
		трендовая	сезонная	случайная
1	2	3	4	5
1	200			-11
2			15	5
3	250		32	
4				

Определить недостающие в таблице данные, учитывая, что общий объем продаж за 1999 г. составил 1000 тыс. у.е.

27. На основе поквартальных данных за 9 последних лет была построена мультипликативная модель некоторого временного ряда. Уравнение тренда в этой модели имеет вид:

$$T_t = 10,8 + 0,1 \cdot t$$

Скорректированные значения сезонной компоненты равны: в 1-м квартале - 1,5; в 3-м квартале - 0,6; в 4-м квартале - 0,8.

Определить сезонную компоненту за 2-й квартал и прогноз моделируемого показателя за 2-й и 3-й кварталы следующего года.

28. На основе помесечных данных за последние 5 лет была построена аддитивная временная модель потребления тепла в районе. Скорректированные значения сезонной компоненты приведены в таблице

Январь	+ 27	Май	- 20	Сентябрь	- 10
Февраль	+ 22	Июнь	- 34	Октябрь	+ 12



Март	+ 15	Июль	- 42	Ноябрь	+20
Апрель	- 2	Август	- 18	Декабрь	?

Уравнение тренда выглядит так:

$$T = 300 + 1,1 \cdot t.$$

Определить значение сезонной компоненты за декабрь, а также точечный прогноз потребления тепла на 2-й квартал следующего года.

29. Дана таблица:

Момент времени	$t-3$	$t-2$	$t-1$	$t$	$t+1$
$S^*$	130				
$S$	145	165	190	210	-

где  $S^*$ ,  $S$  - ожидаемый и действительный объемы предложения. Определить значения  $S^*$  в соответствии с моделью адаптивных ожиданий, приняв  $\lambda = 0,55$ .

30. Ниже приводятся результаты расчета параметров некоторой модели:

$$y_1 = -4 + ???$$

$$y_2 - 9,4x_2 \quad y_2 = 12,83 - 2,67$$

$$y_1 + ???x_1 \quad y_3 = 1,36 - 1,76y_1 + 0,828y_2$$

Приведенная форма модели:

$$y_1 = 2 + 4x_1 - 3x_2$$

$$y_2 = 7,5 + 5x_1 + 8x_2$$

$$y_3 = 4 + ???x_1 + ???x_2.$$

Вставьте пропущенные характеристики

### Самостоятельная работа студентов

Самостоятельная работа студентов является неотъемлемой частью процесса подготовки бакалавров. Она направлена на усвоение системы научных и профессиональных знаний, формирования умений и навыков, приобретение опыта самостоятельной творческой деятельности. СРС помогает формировать культуру мышления студентов, расширять познавательную деятельность.

Виды самостоятельной работы по курсу:

- по целям: подготовка к лекциям, практическим занятиям, рейтингам, НИР.
- по характеру работы: изучение литературы, конспекта лекций, выполнение заданий и тестов, решение задач.

### Примерная тематика самостоятельной работы.

1. Одномерное нормальное распределение и связанные с ним хи-квадрат распределение, распределения Стьюдента и Снедекора-Фишера, их основные свойства.

2. Статистическое оценивание. Точечные оценки. Линейность, несмещенность, эффективность и состоятельность оценок. Принцип максимального правдоподобия.
3. Статистические выводы и проверка статистических гипотез. Ошибки 1-го и 2-го рода. Уровень доверия и проверка значимости. Интервальные оценки, доверительный интервал. Критерии Неймана-Пирсона, Найквиста-Михайлова, Колмогорова-Смирнова.
4. Разложение суммы квадратов отклонений. Дисперсионный анализ. Степень соответствия линии регрессии имеющимся данным. Коэффициент детерминации и его свойства.
5. Классическая линейная регрессия для случая одной объясняющей переменной. Статистические характеристики (математическое ожидание, дисперсия и ковариация) оценок параметров. Теорема Гаусса-Маркова.
6. Предположение о нормальном распределении случайной ошибки в рамках классической линейной регрессии и его следствия. Доверительные интервалы оценок параметров и проверка гипотез о их значимости. Проверка адекватности регрессии. Прогнозирование по регрессионной модели и его точность.
7. Методология эконометрического исследования на примере линейной регрессии для случая одной объясняющей переменной. Особенности представления результатов регрессионного анализа в одном из основных программных пакетов (например в Excel).
8. Особенности регрессии, проходящей через начало координат (без свободного члена). Влияние изменения масштаба измерения переменных на коэффициенты регрессии.
9. Принцип максимального правдоподобия. Сравнение оценок МНК и метода максимального правдоподобия при нормальном распределении ошибок в классической линейной регрессии.
10. Множественная линейная регрессия. Матричная запись эконометрической модели и оценок МНК. Коэффициент множественной детерминации, скорректированный на число степеней свободы.
11. Многомерное нормальное распределение и его плотность распределения. Математическое ожидание и ковариационная матрица линейного преобразования многомерного нормально распределенного вектора. Распределение некоторых квадратичных форм от многомерного нормально распределенного вектора.
12. Проверка значимости коэффициентов и адекватности модели в множественной линейной регрессии. Построение доверительных интервалов и областей для коэффициентов регрессии. Прогнозирование в множественной линейной регрессии, вероятностные характеристики прогноза.



13. Функциональные преобразования переменных в линейной регрессионной модели. Лог-линейная регрессия, как модель с постоянной эластичностью. Модель с постоянными темпами роста (полу-логарифмическая модель). Функциональные преобразования при построении кривых Филлипса и Энгеля. Полиномиальная регрессия.
14. Фиктивные (dummy) переменные в множественной линейной регрессии. Проверка структурных изменений и сравнение двух регрессий с помощью фиктивных переменных. Анализ сезонности. Динамизация коэффициентов линейной регрессии.
15. Проверка общей линейной гипотезы о коэффициентах множественной линейной регрессии. Регрессия с ограничениями на параметры.
16. Понятие об автокорреляции остатков. Экономические причины автокорреляции остатков. Тест серий. Статистика Дарбина-Уотсона. Обобщенный метод наименьших квадратов для оценки регрессии при наличии автокорреляции. Процедура Кокрена-Оркутта. Двух-шаговая процедура Дарбина.
17. Регрессионные динамические модели. Авторегрессия и модель с распределенными лагами. Схема Койека. Адаптивные ожидания.
18. Гетероскедастичности- экономические причины ее наличия. Последствия гетероскедастичности для оценок МНК. Признаки присутствия гетероскедастичности. Тесты Бройша-Пагана, Голфелда-Квандта, Парка, Глейзера, ранговая корреляция по Спирмену.
19. Взвешенный метод наименьших квадратов. Выбор «наилучшей» модели. Ошибка спецификации модели. Пропущенные и излишние переменные.
20. Мультиколлинеарность данные и последствия этого для оценок параметров регрессионной модели. Идеальная и практическая мультиколлинеарность (квазимультиколлинеарность). Показатели степени мультиколлинеарности. Вспомогательные регрессии. Методы-борьбы с мультиколлинеарностью.

#### Вопросы к зачету

1. Предмет эконометрики как науки.
2. Методология эконометрических исследований.
3. Специфика эконометрических методов.
4. Задачи, решаемые эконометрическими методами.
5. Линейные уравнения регрессии (классическая модель).
6. Метод наименьших квадратов и его свойства.
7. Линейная регрессионная модель для случая одной факторной переменной.
8. Регрессия по эмпирическим (выборочным) данным и теоретическая регрессия.

9. Экономическая интерпретация параметров линейного уравнения регрессии.
10. Обоснование и отбор факторов при построении множественной регрессии.
11. Линейная регрессионная модель с многими переменными.
12. Оценка и интерпретация параметров.
13. Коэффициенты множественной детерминации.
14. Мультипликативные модели регрессии и их линеаризация.
15. Гиперболическая регрессия.
16. Полиномиальная и кусочно-полиномиальная регрессия.
17. Экспоненциальная и степенная регрессии.
18. Оценка качества эконометрических регрессионных моделей и прогнозирование на их основе.
19. Значимость модели регрессии и коэффициентов регрессии.
20. Доверительный интервал прогноза.
21. Гетероскедастичность, ее экономические причины и методы выявления.
22. Показатели мультиколлинеарности и методы борьбы с нею.
23. Экономические причины автокоррелированности случайных ошибок.
24. Характеристики временных рядов. Моделирование сезонных и циклических колебаний.
25. Статистика Дарбина-Уотсона.
26. Модели, представленные системами одновременных линейных уравнений.
27. Эконометрические модели интегрированного типа.
28. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

## 7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

### а) основная литература:

(имеется в наличии в библиотеке ВлГУ)

1. Эконометрика: Учебное пособие / А.И. Новиков. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 272 с.: 60x88 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат). (обложка) ISBN 978-5-16-004634-1, 500 экз. — Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=437118>
2. Эконометрика. Практикум: Учебное пособие / С.А. Бородич. - М.: НИЦ ИНФРА-М; Мн.: Нов. знание, 2014. - 329 с.: ил.; 60x90 1/16. - (Высшее образование: Бакалавриат). (переплет) ISBN 978-5-16-009429-8, 500 экз.- Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=440758>



3. Эконометрика - 2: продвинутый курс с приложениями в финансах: Учеб. / С.А. Айвазян, Д. Фантацини; Московская школа экономики МГУ им. М.В. Ломоносова (МШЭ) - М.: Магистр: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 944 с.: 70x100 1/32. (п) ISBN 978-5-9776-0333-1, 100 экз.- Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=472607>

**б) дополнительная литература**

1. Картаев, Ф.С. Эконометрика [Электронный ресурс] : учебное пособие / Ф.С. Картаев, Е.Н. Лукаш. - М.: Проспект, 2014. - 118 с. - ISBN 978-5-392-16622-0.- Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=534320>
2. Экономико-математические методы и модели: компьютерное моделирование: Учебное пособие / И.В. Орлова, В.А. Половников. - 3-е изд., перераб. и доп. - М.: Вузовский учебник: НИЦ ИНФРА-М, 2014. - 389 с.: 60x90 1/16. (п) ISBN 978-5-9558-0208-4.- Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=424033>
3. Скользящие вдоль временных рядов: Монография / Агранович Ю.Я., Концевая Н.В. - М.: Вузовский учебник, НИЦ ИНФРА-М, 2015. - 90 с.: 60x90 1/16. - (Научная книга) (Обложка) ISBN 978-5-9558-0483-5.- Режим доступа: <http://znanium.com/catalog.php?bookinfo=538042>

**в) периодические издания:**

1. Журнал «Прикладная эконометрика».
2. Журнал «Экономика и математические методы»

**г) интернет-ресурсы:**

1. [www.gks.ru](http://www.gks.ru) – Госкомстат РФ.
2. [www.sea.gov.ru](http://www.sea.gov.ru) – Аналитический центр при правительстве Российской Федерации.
3. [www.rbk.ru](http://www.rbk.ru) – РБК (РосБизнесКонсалтинг).
4. [www.stat.hse.ru](http://www.stat.hse.ru) – Статистическая база данных НИУ ВШЭ.
5. <http://prognoz.org> – Прогнозы и прогнозирование. Методы прогнозирования. Технологии.
6. [repec.org](http://repec.org) – RePEc (Research Papers in Economics) – база данных, содержащая статьи, различные материалы по экономике (на англ. яз.).
7. [www.cemi.rssi.ru](http://www.cemi.rssi.ru) – Центральный экономико-математический институт РАН (ЦЭМИ).
8. [www.forecast.ru/mainframe.asp](http://www.forecast.ru/mainframe.asp) – Центр макроэкономического анализа и прогнозирования.
9. [www.ecfor.ru](http://www.ecfor.ru) – Институт народнохозяйственного прогнозирования РАН.
10. <http://www.spssbase.com/> Иллюстрированный самоучитель по SPSS
11. <http://www.spss.ru> Официальный сайт российского офиса компании SPSS
12. [allmatematika.ru](http://allmatematika.ru)
13. <http://e.lib.vlsu.ru>

## 8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### 1. Лекционные занятия:

- учебная аудитория (214-6, 213-6) с мультимедийным оборудованием.
- курс лекций по дисциплине.

### 2. Практические занятия:

- компьютерный класс;
- презентационная техника: проектор, экран, ноутбук;
- пакеты ПО общего назначения: Microsoft Word и Microsoft PowerPoint.



Рабочая программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению 38.03.01 «Экономика», профиль подготовки «Экономика предприятий и организаций»

Рабочую программу составил Эр канд. физ. – мат. наук, доцент М.Б. Хрипунова

Рецензент:

Заместитель председателя Счётной палаты

Владимирской области

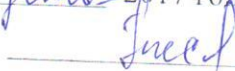


А.Ф. Манов

Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры БИЭ

протокол № 1 от «28» августа 2017 года.

Заведующий кафедрой

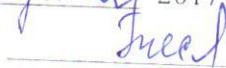


д.э.н., профессор Тесленко И.Б.

Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии направления 38.03.01 Экономика

протокол № 1 от «28» августа 2017 года.

Председатель комиссии



д.э.н., профессор Тесленко И.Б.

ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ

РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Рабочая программа одобрена на \_\_\_\_\_ учебный год.

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ года.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_

Рабочая программа одобрена на \_\_\_\_\_ учебный год.

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ года.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_

Рабочая программа одобрена на \_\_\_\_\_ учебный год.

Протокол заседания кафедры № \_\_\_\_\_ от \_\_\_\_\_ года.

Заведующий кафедрой \_\_\_\_\_