

Министерство науки и высшего образования 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

 И.А.Панфилов
 « 30 » 08 2019 г.



РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ
ЭКОНОМЕТРИКА

Направление подготовки - 38.04.01 «Экономика»

Профиль / программа подготовки – «Учет и налоговое планирование в коммерческих организациях»

Уровень высшего образования - магистратура

Форма обучения – заочная

Семестр	Трудоемкость зач. ед./ час.	Лекции, час.	Практич. занятия, час.	Лаборат. работы, час.	СРС, час.	Форма промежу- точной аттестации (экс./зачет/зачет с оценкой)
2	2/72		10		26	Экзамен (36)
Итого	2/72		10		26	Экзамен (36)

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цели освоения дисциплины «Эконометрика» - овладеть знаниями объединения общих основ статистической и экономической науки и навыками проведения эконометрического исследования.

Задачи:

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 выбора 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. Пререквизиты дисциплины: «Математика».

3. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения ОПОП

Код формируемых компетенций	Уровень освоения компетенции	Планируемые результаты обучения по дисциплине характеризующие этапы формирования компетенций (показатели освоения компетенции)
1	2	3
(ПК – 6) – способность оценивать эффективность проектов с учетом фактора неопределенности	частичный уровень освоения компетенции	В результате освоения дисциплины обучающийся должен демонстрировать следующие результаты образования: 1. Знать: методы оценки эффективности бизнес-проектов и программ. 2. Уметь: применять современный математический инструментарий для решения содержательных экономических задач, в том числе для оценки эффективности проектов и расчета основных показателей с учетом фактора неопределенности и риска. 3. Владеть: методиками построения эконометрических моделей, позволяющей совершенствовать

		методики оценки эффективности проектов в условиях неопределенности.
(ПК – 8) – способность готовить аналитические материалы для оценки мероприятий в области экономической политики и принятия стратегических решений на микро- и макроуровне	частичный уровень освоения компетенции	<p>В результате освоения дисциплины обучающийся должен продемонстрировать следующие результаты образования:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Знать: методологию и методы разработки стратегии экономических субъектов, методы сбора и оценки аналитических материалов для выработки и принятия стратегий деятельности предприятий. 2. Уметь: применять современный эконометрический инструментарий для обработки аналитических материалов. 3. Владеть: навыками интерпретации полученных в процессе анализа результатов для принятия стратегических решений на микро и макро-уровне.
(ПК – 9) – способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов	частичный уровень освоения компетенции	<p>В результате освоения дисциплины обучающийся должен продемонстрировать следующие результаты образования:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Знать: формы и структуру бухгалтерской финансовой отчетности, источники экономической и финансовой информации и методы их анализа. 2. Уметь: классифицировать источники информации и проводить анализ информации для проведения экономических расчетов. 3. Владеть: методами первичной обработки статистических данных из различных источников информации.
(ПК – 10) – способность составлять прогноз основных социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	частичный уровень освоения компетенции	<p>В результате освоения дисциплины обучающийся должен продемонстрировать следующие результаты образования:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Знать: методы составления прогнозов на микро- и макроуровне, в том числе деятельности предприятия, отрасли, региона и национальной экономики. 2. Уметь: составлять прогнозы развития конкретных экономических процессов на микро-и макроуровне, в том числе разработать прогнозы деятельности предприятия, отрасли, региона и национальной экономики. 3. Владеть: навыками микроэкономического и макроэкономического моделирования с применением современных инструментов, методами разработки прогнозов деятельности предприятия, отрас-

4. ОБЪЕМ И СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Трудоемкость дисциплины составляет 2 зачетные единицы, 72 часа

№ п/п	Раздел 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	Практические занятия	Лабораторные работы	СРС	КР		
1.	Предмет, метод и задачи дисциплины «Эконометрика»	2	41		2		3		1/50	Рейтинг-контроль №1
2.	Линейные однофакторные регрессионные модели	2	41				3			
3.	Эконометрические модели множественной регрессии	2	41		2		3		1/50	
4.	Нелинейные модели и их линеаризация	2	42		2		3		1/50	
5.	Оценка качества эконометрических регрессионных моделей и прогнозирование на их основе	2	42				3			
6.	Временные ряды	2	42		2		3		1/50	Рейтинг-контроль №2
7.	Системы эконометрических уравнений	2	43		2		8		1/50	Рейтинг-контроль №3
Итого за второй семестр:					10		26		5/50	Экзамен (36)
Наличие в дисциплине КР/КР										
Итого по дисциплине:					10		26		5/50	Экзамен (36)

Содержание практических занятий по дисциплине**Тема 1. Предмет, метод и задачи дисциплины «Эконометрика».**

Предмет эконометрики как науки. Методология эконометрических исследований. Специфика эконометрических методов. Задачи, решаемые эконометрическими методами.

Тема 3. Эконометрические модели множественной регрессии.

Обоснование и отбор факторов при построении множественной регрессии. Линейная регрессионная модель с многими переменными. Оценка и интерпретация параметров. Коэффициенты множественной детерминации.

Тема 4. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация.

Мультипликативные модели регрессии и их линеаризация. Гиперболическая регрессия. Полиномиальная и кусочно-полиномиальная регрессия. Экспоненциальная и степенная регрессии.

Тема 6. Временные ряды.

Характеристики временных рядов. Моделирование сезонных и циклических колебаний. Статистика Дарбина - Уотсона.

Тема 7. Системы эконометрических уравнений.

Модели, представленные системами одновременных линейных уравнений. Эконометрические модели интегрированного типа. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

5. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

В соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.0 «Экономика», программа подготовки «Учет и налоговое планирование в коммерческих организациях» 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:

- анализ ситуаций (тема № 6);
- групповая дискуссия (тема № 1);
- работа в команде (тема № 7).

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

Текущий контроль успеваемости (рейтинг-контроль 1, рейтинг-контроль 2, рейтинг-контроль 3). Типовые тестовые задания для проведения текущего контроля приведены ниже.

Рейтинг-контроль №1

1. На стыке каких областей знаний возникла эконометрика:

- а) экономическая теория; экономическая и математическая статистика;
- б) экономическая теория, математическая статистика и теория вероятности;
- в) экономическая и математическая статистика, теория вероятности.

2. Эконометрику можно определить как:

- а) это самостоятельная научная дисциплина, объединяющая совокупность теоретических результатов, приемов, методов и моделей, предназначенных для того, чтобы на

базе экономической теории, экономической статистики и математико-статистического инструментария придавать конкретное количественное выражение общим (качественным) закономерностям, обусловленным экономической теорией;

- б) наука об экономических измерениях;
- в) статистический анализ экономических данных.

3. К задачам эконометрики можно отнести:

- а) прогноз экономических и социально-экономических показателей, характеризующих состояние и развитие анализируемой системы;
- б) имитация возможных сценариев социально-экономического развития системы для выявления того, как планируемые изменения тех или иных поддающихся управлению параметров скажутся на выходных характеристиках;
- в) проверка гипотез по статистическим данным.

4. При прямой связи с увеличением факторного признака:

- а) результативный признак уменьшается;
- б) результативный признак не изменяется;
- в) результативный признак увеличивается.

5. Какие методы используются для выявления наличия, характера и направления связи в статистике?

- а) средних величин;
- б) сравнения параллельных рядов;
- в) метод аналитической группировки;
- г) относительных величин;
- д) графический метод.

6. Отметьте обстоятельства, которые должны учитываться при выборе теоретической формы корреляционной связи:

- а) объем изучаемой совокупности;
- б) предварительный теоретический анализ внутренних связей явлений;
- в) фактически сложившиеся закономерности в связном изменении явлений.

7. Выбор списка переменных модели и типа взаимосвязи между ними выполняется на этапе:

- а) спецификация модели;
- б) оценка параметров модели;
- в) сбор статистической информации об объеме исследования;
- г) проверка адекватности модели.

8. Этапы построения эконометрической модели:

- а) оценка параметров модели (параметризация);
- б) спецификация модели;
- в) проверка адекватности модели;
- г) сбор статистической информации об объеме исследования.

Рейтинг-контроль № 2

1. Оценка значимости параметров уравнения регрессии осуществляется на основе:

- а) t - критерия Стьюдента;
- б) F - критерия Фишера – Снедекора;
- в) средней квадратической ошибки;
- г) средней ошибки аппроксимации.

2. Коэффициент регрессии в уравнении $\hat{y} = 9,2 + 1,5 \cdot x$, характеризующем связь между объемом реализованной продукции (млн. руб.) и прибылью предприятий автомобильной промышленности за год (млн. руб.) означает, что при увеличении объема реализованной продукции на 1 млн. руб. прибыль увеличивается на:

- а) 0,5 %;
- б) 0,5 млн. руб.;
- в) 500 тыс. руб.;
- г) 1,5 млн. руб.

3. Корреляционное отношение (индекс корреляции) измеряет степень тесноты связи между X и Y :

- а) только при нелинейной форме зависимости;
- б) при любой форме зависимости;
- в) только при линейной зависимости.

4. По направлению связи бывают:

- а) умеренные;
- б) прямые;
- в) прямолинейные.

5. На чем основан тест ранговой корреляции Спирмена?

- а) На использовании t – статистики;
- б) На использовании F – статистики;
- в) На использовании χ^2 ;
- г) На графическом анализе остатков.

6. Каким методом можно воспользоваться для устранения автокорреляции?

- а) Обобщенным методом наименьших квадратов;
- б) Взвешенным методом наименьших квадратов;
- в) Методом максимального правдоподобия;
- г) Двухшаговым методом наименьших квадратов.

7. Фиктивные переменные вводятся в:

- а) только в линейные модели;
- б) только во множественную нелинейную регрессию;
- в) только в нелинейные модели;
- г) как в линейные, так и в нелинейные модели, приводимые к линейному виду.

8. С помощью какой меры невозможно избавиться от мультиколлинеарности?

- а) Увеличение объема выборки;
- б) Исключения переменных высокоррелированных с остальными;
- в) Изменение спецификации модели;
- г) Преобразование случайной составляющей.

9. Какой показатель используется для определения части вариации, обусловленной изменением величины изучаемого фактора?

- а) коэффициент вариации;
- б) коэффициент корреляции;
- в) коэффициент детерминации;
- г) коэффициент эластичности.

10. Какие методы можно применить для обнаружения гетероскедастичности?

- а) Тест Голфелда-Квандта;
- б) Тест ранговой корреляции Спирмена;
- в) Тест Дарбина- Уотсона.

11. Коэффициент эластичности определяется по формуле $\hat{Y} = x \cdot \ln b$ для модели регрессии в форме:

- а) Линейной функции;
- б) Параболы;
- в) Гиперболы;
- г) Показательной кривой;
- д) Степенной.

12. Коэффициент эластичности определяется по формуле $\hat{Y} = b$ для модели регрессии в форме:

- а) Линейной функции;

- б) Параболы;
- в) Гиперболы;
- г) Показательной кривой;
- д) Степенной.

13. Какие из приведенных чисел могут быть значениями коэффициента детерминации:

- а) 0,56;
- б) -1;
- в) -0,97;
- г) -0,9.

14. Отметьте правильную форму линейного уравнения регрессии:

- а) $\hat{y} = a + \frac{b}{x}$;
- б) $\hat{y} = a \cdot b^x$;
- в) $\hat{y} = a \cdot x^b$;
- г) $\hat{y} = a + bx$.

Рейтинг-контроль №3

1. Если $M - m \geq k - 1$ и ранг матрицы A меньше $(K-1)$ то уравнение:

- а) сверхидентифицировано;
- б) неидентифицировано;
- в) точно идентифицировано.

2. В чем состоит проблема идентификации модели?

- а) получение однозначно определенных параметров модели, заданной системой одновременных уравнений;
- б) выбор и реализация методов статистического оценивания неизвестных параметров модели по исходным статистическим данным;
- в) проверка адекватности модели.

3. Для оценивания параметров точно идентифицируемой системы уравнений применяется:

- а) ДМНК, КМНК;
- б) ДМНК, МНК, КМНК;
- в) КМНК.

4. Если $M - m = k - 1$ и ранг матрицы A равен $(K-1)$ то уравнение:

- а) сверхидентифицировано;

- б) неидентифицировано;
- в) точно идентифицировано;

5. Временной ряд – это:

- а) последовательность упорядоченных во времени числовых показателей, характеризующих уровень состояния и изменения изучаемого явления;
- б) последовательность числовых показателей, характеризующих уровень состояния и изменения изучаемого явления;
- в) последовательность упорядоченных временных интервалов, или моментов времени.

6. При каком значении средней относительной ошибки по модулю модель имеет высокую точность:

- а) менее 10%;
- б) выше 10%;
- в) от 10% до 20%.

7. Ряд динамики характеризует:

- а) структуру совокупности по какому-либо признаку;
- б) изменение значений признака во времени;
- в) определенное значение варьирующего признака в совокупности;
- г) факторы изменения показателя на определенную дату или за определенный период.

8. Периодические колебания, возникающие под влиянием смены времени года называются...:

- а) хронологическими;
- б) сезонными;
- в) тенденцией;
- г) случайными.

Самостоятельная работа студентов

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

Виды самостоятельной работы по курсу:

- а) по целям: подготовка к практическим занятиям, рейтингам, самостоятельной работе.

б) по характеру работы: изучение литературы, написание эссе, выполнение заданий и тестов, выполнение практических работ, подготовка доклада.

Примерная тематика самостоятельной работы

Примерная тематика рефератов

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.
3. Принцип максимального правдоподобия.
4. Статистические выводы и проверка статистических гипотез.
5. Ошибки 1-го и 2-го рода.
6. Уровень доверия и проверка значимости. Интервальные оценки, доверительный интервал.
7. Критерии Неймана-Пирсона, Найквиста-Михайлова, Колмогорова-Смирнова.
8. Разложение суммы квадратов отклонений.
9. Дисперсионный анализ.
10. Степень соответствия линии регрессии имеющимся данным.
11. Коэффициент детерминации и его свойства.
12. Классическая линейная регрессия для случая одной объясняющей переменной.
13. Статистические характеристики (математическое ожидание, дисперсия и ковариация) оценок параметров. Теорема Гаусса-Маркова.
14. Предположение о нормальном распределении случайной ошибки в рамках классической линейной регрессии и его следствия.
15. Прогнозирование по регрессионной модели и его точность.
16. Методология эконометрического исследования на примере линейной регрессии для случая одной объясняющей переменной.
17. Особенности представления результатов регрессионного анализа в одном из основных программных пакетов (например в Excel).
18. Особенности регрессии, проходящей через начало координат (без свободного члена). Влияние изменения масштаба измерения переменных на коэффициенты регрессии.
19. Принцип максимального правдоподобия. Сравнение оценок МНК и метода максимального правдоподобия при нормальном распределении ошибок в классической линейной регрессии.

20. Множественная линейная регрессия. Матричная запись эконометрической модели и оценок МНК.
 21. Коэффициент множественной детерминации, скорректированный на число степеней свободы.
 22. Многомерное нормальное распределение и его плотность распределения.
 23. Математическое ожидание и ковариационная матрица линейного преобразования многомерного нормально распределенного вектора.
 24. Распределение некоторых квадратичных форм от многомерного нормально распределенного вектора.
 25. Функциональные преобразования переменных в линейной регрессионной модели.
 26. Лог-линейная регрессия, как модель с постоянной эластичностью.
 27. Модель с постоянными темпами роста (полу-логарифмическая модель).
 28. Функциональные преобразования при построении кривых Филлипса и Энгеля.
- Полиномиальная регрессия.
29. Фиктивные (dummy) переменные в множественной линейной регрессии. Проверка структурных изменений и сравнение двух регрессий с помощью фиктивных переменных.
 30. Анализ сезонности.
 31. Динамизация коэффициентов линейной регрессии.
 32. Проверка общей линейной гипотезы о коэффициентах множественной линейной регрессии.
 33. Регрессия с ограничениями на параметры.
 34. Понятие об автокорреляции остатков. Экономические причины автокорреляции остатков.
 35. Обобщенный метод наименьших квадратов для оценки регрессии при наличии автокорреляции.
 36. Процедура Кокрена-Оркутта.
 37. Двух-шаговая процедура Дарбина.
 38. Регрессионные динамические модели. Авторегрессия и модель с распределенными лагами. Схема Койека. Адаптивные ожидания.
 39. Гетероскедастичности- экономические причины ее наличия.
 40. Последствия гетероскедастичности для оценок МНК.
 41. Признаки присутствия гетероскедастичности.
 42. Тесты Бройша-Пагана, Голфелда-Квандта, Парка, Глейзера, ранговая корреляция по Спирмену.

43. Мультиколлинеарность данные и последствия этого для оценок параметров регрессионной модели. Идеальная и практическая мультиколлинеарность (квазимультиколлинеарность). Показатели степени мультиколлинеарности. Вспомогательные регрессии. Методы-борьбы с мультиколлинеарностью.

Варианты задач для самостоятельной работы

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

$$z = a\sqrt{x} + b \frac{x}{y}$$

2. Линеаризовать уравнение $z = a\sqrt{x} + b \frac{x}{y}$ в точке x_0, y_0 .

3. Линеаризация нелинейного ДУ. $3xy - 4x^2 + 1,5 \frac{dx}{dt} = 5 \frac{dy}{dt} + y$.

4. Линеаризовать уравнение состояния $x' = -x^2 u$, $x, u \in \mathbf{R}$.

5. По 20 предприятиям легкой промышленности получена следующая информация (таблица), 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.):

$$\text{Уравнение регрессии } y = 35 + 0,06x_1 + 2,5x_2$$

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.

6. 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.

7. 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

$$\text{Уравнение регрессии } y = ??? + 0,48x_1 + 20x_2,$$

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.

8. 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 (табл. 1 и 2):

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.

9. Регрессия зависимой переменной y на три независимые переменные на основе $n=30$ наблюдений дала следующие результаты (таблица):

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.

10. 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 (таблица):

Множественный коэффициент корреляции 0,85

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.

11. 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 (таблица):

Множественный коэффициент корреляции 0,85

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.

12. 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 (таблицы 1 и 2)

$R = 0,77$

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

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

$R = 0,81$

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.

13. По ежегодным данным с 2000 по 2010 год (всего 11 наблюдений) оценивается тренд туристического потока из России в Финляндию с помощью уравнения регрессии $Tripst_t = \beta_0 + \beta_1 t + \varepsilon_t$. 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: $\hat{\beta}_0 = 253000$ (8.6), $\hat{\beta}_1 = 278.8$ (40.4), $R^2 = 0.7$, $TSS = 278.8$. 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 β_1 . в) Оцените дисперсию случайной составляющей ε_t .

14. 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: $\hat{\beta}_0 = 41.9$ (3.0), $\hat{\beta}_1 = 4.6$ (0.2), $R^2 = 0.9$. 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?

15. 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.

16. Ниже приводятся результаты расчета параметров некоторой модели:

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

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

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

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

Промежуточная аттестация по итогам освоения дисциплины (экзамен).

Вопросы к экзамену

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.

25. Моделирование сезонных и циклических колебаний.
26. Статистика Дарбина - Уотсона.
27. Модели, представленные системами одновременных линейных уравнений.
28. Эконометрические модели интегрированного типа.
29. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

Фонд оценочных средств для проведения аттестации уровня сформированности компетенций обучающихся по дисциплине оформляется отдельным документом.

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ

ДИСЦИПЛИНЫ

7.1. Книгообеспеченность

№ п / п	Название литературы: (автор, название, издательство)	Год издания	Книгообеспеченность	
			Количество экземпляров изданий в библиотеке ВлГУ в соответствии с ФГОС ВО	Наличие в электронной библиотеке ВлГУ
1	2	3	4	5
Основная литература				
1	Эконометрика / Новиков А.И. - М.: Дашков и К, 2017. - 224 с.	2017		http://znanium.com/catalog/product/415339
2	Эконометрика / Буравлев А.И., - 3-е изд., (эл.) - М.: Лаборатория знаний, 2017. - 167 с.	2017		http://znanium.com/catalog/product/542629
3	Эконометрика : теория и практика : учеб. пособие / Л.И. Ниворожкина, С.В. Арженовский, Е.П. Кокина. — М. : РИОР : ИНФРА-М, 2018. — 207 с	2018		http://znanium.com/catalog/product/907587
Дополнительная литература				
1	Эконометрика: теоретические основы: Учебное пособие / Г.А. Соколов. - М.: НИЦ ИНФРА-М, 2016. - 216 с.	2016		http://znanium.com/catalog/product/503663
2	Эконометрика (продвинутый уровень): Конспект лекций / Крянев А.В. - М.: КУРС, НИЦ ИНФРА-М, 2017. - 62 с.	2017		http://znanium.com/catalog/product/767248
3	Эконометрика и эконометрическое моделирование : учебник / Л.О. Бабешко, М.Г. Бич, И.В. Орлова. - М. : Вузовский учебник : ИНФРА-М, 2018. - 385 с.	2018		http://znanium.com/catalog/product/968797
4	Эконометрика. Практикум : учеб. пособие / С.А. Бородич. — Минск : Новое знание ; М. : ИНФРА-М, 2018. — 329 с.	2018		http://znanium.com/catalog/product/988809
5	Практическая эконометрика в кейсах : учеб. пособие / В.П. Неужин, Ю.В. Неужин. — М. : ИД «ФОРУМ» : ИНФРА-М, 2018. — 317 с.	2018		http://www.znanium.com]. — (Высшее образование: Бакалавриат). — www.dx.doi.org/10.12737/20052 .

7.2 периодические издания

1. Журнал «Прикладная эконометрика».
2. Журнал «Экономика и математические методы»
3. Журнал «Вопросы статистики». Входит в список ВАК.
4. Журнал «Учет и статистика».

7.3 интернет-ресурсы

1. www.gks.ru – Госкомстат РФ.
2. www.cea.gov.ru – Аналитический центр при правительстве Российской Федерации.
3. www.rbk.ru – РБК (РосБизнесКонсалтинг).
4. www.stat.hse.ru – Статистическая база данных НИУ ВШЭ.
5. <http://prognoz.org> – Прогнозы и прогнозирование. Методы прогнозирования. Технологии.
6. repec.org – RePEc (ResearchPapersinEconomics) – база данных, содержащая статьи, различные материалы по экономике (на англ. яз.).
7. www.cemi.rssi.ru – Центральный экономико-математический институт РАН (ЦЭМИ).
8. www.forecast.ru/mainframe.asp – Центр макроэкономического анализа и прогнозирования.
9. www.esfor.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

8. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Для реализации данной дисциплины имеются специальные помещения для проведения занятий лекционного типа, занятий практического/лабораторного типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы.

Практические работы проводятся в аудиториях, оснащенных мульти-медиа оборудованием, компьютерных классах с доступом в интернет.

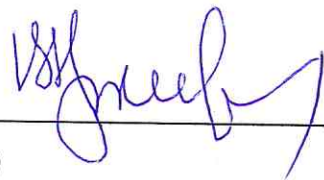
Перечень используемого лицензионного программного обеспечения:

- Операционная система семейства Microsoft Windows.
- Пакет офисных программ MicrosoftOffice.
- Консультант+.

Рабочую программу составил

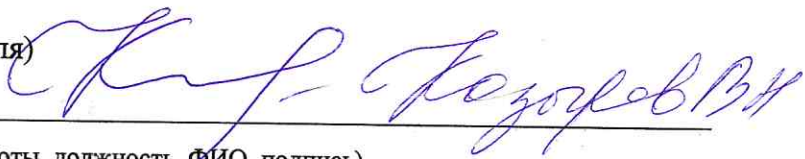
к.ф. -м.н., доцент, доцент каф. БИиЭ, Крылов В.Е.

(ФИО, подпись)



Рецензент (представитель работодателя)

(место работы, должность, ФИО, подпись)

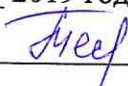


Программа рассмотрена и одобрена на заседании кафедры БИиЭ

протокол № 1 от 30 августа 2019 года

Заведующий кафедрой

/Тесленко И.Б./

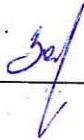


Рабочая программа рассмотрена и одобрена на заседании учебно-методической комиссии
направления подготовки 38.04.01 «Экономика»

протокол № 1/1 от 30 августа 2019 года

Председатель комиссии

/Затаров В.М./



**ЛИСТ ПЕРЕУТВЕРЖДЕНИЯ
РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЫ ДИСЦИПЛИНЫ**

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 _____

ЛИСТ РЕГИСТРАЦИИ ИЗМЕНЕНИЙ

в рабочую программу дисциплины

«ЭКОНОМЕТРИКА»

образовательной программы

направление подготовки 38.04.01 «Экономика»

профиль / программа подготовки «Учет и налоговое планирование

в коммерческих организациях»

уровень высшего образования магистратура

Номер изменения	Внесены изменения в части/разделы рабочей программы	Исполнитель ФИО	Основание (номер и дата протокола заседания кафедры)
1			
2			

Заведующий кафедрой _____ / _____

Подпись

ФИО