

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«ДАГЕСТАНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
Факультет управления

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Эконометрика (продвинутый уровень)

Кафедра «Математическое моделирование, эконометрика и статистика»

Образовательная программа

38.04.05 Бизнес-информатика

Профиль подготовки
Информационная бизнес-аналитика

Уровень высшего образования
Магистратура

Форма обучения
Очная

Статус дисциплины: вариативная

Махачкала, 2016

Рабочая программа дисциплины «Эконометрика» составлена в 2016 году в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.05 Бизнес-информатика (уровень магистратуры)

от «08» апреля 2015г. №370.

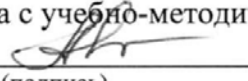
Разработчик(и): кафедра ММЭиС, Джаватов Д.К., д.т.н., проф.

Рабочая программа дисциплины одобрена:
на заседании кафедры ММЭиС от «26» января 2016г., протокол № 5

Зав. кафедрой  Джаватов Д.К.
(подпись)

на заседании Методической комиссии факультета управления от « 29 »
января 2016 г., протокол № 6 .

Председатель  Камалова Т.А.
(подпись)

Рабочая программа дисциплины согласована с учебно-методическим управлением « 2 » февраля 2016 г. 
(подпись)

Содержание

Аннотация рабочей программы дисциплины.....	4
1. Цели освоения дисциплины.....	5
2. Место дисциплины в структуре ООП бакалавриата.....	5
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (перечень планируемых результатов обучения).....	5
4. Объем, структура и содержание дисциплины.....	6
4.1. Объем дисциплины.....	6
4.2. Структура дисциплины.....	6
4.3. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам).....	8
5. Образовательные технологии.....	9
6. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов.....	10
7. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины.....	12
7.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы.....	12
7.2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций, описание шкал оценивания.....	12
7.3. Типовые контрольные задания.....	13
7.4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.....	19
8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.....	19
9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.....	20
10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.....	20
11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.....	21
12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.....	21

Аннотация рабочей программы дисциплины

Дисциплина «Эконометрика» входит в вариативную часть образовательной программы магистратуры по направлению 38.04.05 «Бизнес-информатика».

Дисциплина реализуется на факультете управления кафедрой «Математическое моделирование, эконометрика и статистика».

Содержание дисциплины охватывает круг вопросов, связанных с профессиональными навыками решения задач выявления и количественного определения (на основе статистических данных) взаимосвязей, существующих между экономическими величинами и процессами и оценивающих существующие причинно-следственные связи.

Дисциплина нацелена на формирование следующих компетенций выпускника: профессиональных - ПК-3, ПК-10.

Преподавание дисциплины предусматривает проведение следующих видов учебных занятий: лекции, практические занятия, лабораторные занятия, самостоятельная работа.

Рабочая программа дисциплины предусматривает проведение следующих видов контроля успеваемости: текущий контроль в форме опроса, тестов, контрольных работ и промежуточный контроль в форме зачета (9 семестр), экзамена (10 семестр).

Объем дисциплины 5 зачетных единиц, в том числе в академических часах по видам учебных занятий 180ч.

Семестр	Учебные занятия						СРС, в том числе экза- мен	Форма промежу- точной аттеста- ции (зачет, диф- ференцированный зачет, экзамен)
	в том числе							
	Контактная работа обучающихся с преподавателем							
	Все- го	из них						
Лек- ции		Лаборатор- ные заня- тия	Практи- ческие занятия	КСР	консуль- тации			
9	72	10	-	12	-	-	50	зачет
A	108	12	-	12	36	-	48	экзамен

1. Цели освоения дисциплины

Целями освоения дисциплины «Эконометрика» являются: получение представления об основных положениях эконометрической науки, овладение основными методами эконометрического исследования и их применение к анализу и прогнозированию экономических процессов и явлений.

2. Место дисциплины в структуре ООП магистратуры

Дисциплина «Эконометрика» входит в вариативную часть образовательной программы магистратуры по направлению 38.04.05 «Бизнес-информатика».

Дисциплина «Эконометрика» изучается на первом курсе в первом семестре и является базовым теоретическим и практическим основанием для производственной практики, дипломного проектирования при подготовке магистров направления 38.04.05 «Бизнес-информатика».

Входные знания, умения и компетенции, необходимые для изучения данного курса, формируются в процессе изучения дисциплин базовой части основной образовательной программы подготовки бакалавриата по направлению 38.04.05 «Бизнес-информатика».

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (перечень планируемых результатов обучения).

Компетенции	Формулировка компетенции из ФГОС ВО	Планируемые результаты обучения (показатели достижения заданного уровня освоения компетенций)
ПК-3	применять методы системного анализа и моделирования для анализа архитектуры предприятий	Знать: современные методы эконометрического анализа Уметь: применять современный математический инструментарий для решения содержательных экономических задач Владеть: современной методикой построения эконометрических моделей

ПК-10	проводить исследования и поиск новых моделей и методов совершенствования архитектуры предприятия	<p>Знать: особенности эконометрического метода и измерений в экономике, методы и особенности эконометрического прогнозирования социально-экономических процессов</p> <p>Уметь: формировать прогнозы развития конкретных экономических процессов на микро- и макроуровне</p> <p>Владеть: методами количественного анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования</p>
-------	--	---

4. Объем, структура и содержание дисциплины.

4.1. Объем дисциплины составляет 5 зачетных единиц, 180 академических часов.

4.2. Структура дисциплины.

9 семестр

№ п/п	Разделы и темы дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра) Форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лаборатор-	Контроль самост. раб.		
	Модуль 1. Методология эконометрического исследования. Регрессионные эконометрические модели								
1	Сущность эконометрической модели, её специфика в ряду экономико-математических моделей	9	1-2	2	2			12	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
2	Корреляционно-регрессионный анализ. Множественная и частная корреляция.	9	3-5	2	4			14	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
	<i>Итого по модулю 1:</i>	9		4	6			26	Контрольная работа

Модуль 2. Эконометрические модели временных рядов									
3	Модели тренда. Моделирование циклических колебаний временного ряда.	9	6-7	2	2			8	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
4	Прогнозирование динамических процессов на основе моделей тренда	9	8-9	2	2			8	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
5	Макро и региональные эконометрические модели	9	16-17	2	2			8	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
	<i>Итого по модулю 2:</i>	9		6	6			24	Контрольная работа
	<i>Промежуточный контроль</i>	9							Зачет
	ИТОГО	72	1-17	10	12			50	

А семестр

№ п/п	Разделы и темы дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)				Самостоятельная работа	Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра) Форма промежуточной аттестации (по семестрам)
				Лекции	Практические занятия	Лаборатор-	Контроль самост. раб.		
Модуль 1. Системы линейных одновременных уравнений.									
1	Системы эконометрических уравнений: виды, применение	А	1-2	2	2			14	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
2	Методы решения систем одновременных уравнений.	А	3-4	2	2			14	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
	<i>Итого по модулю 1:</i>	А		4	4			28	Контрольная работа
Модуль 2. Динамические эконометрические модели. Построение эконометрических моделей для изучения и анализа региональной экономики.									
3	Моделирование динамических процессов. Эконометрические модели панельных данных.	А	5-8	4	4			10	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа
4	Построение регрессионных моделей для анализа и прогнозирования экономических процес-	А	9-12	4	4			10	Опрос, тестирование, домашняя контрольная работа

сов региона. Построение и исследование систем эконометрических уравнений для региона.									
<i>Итого по модулю 2:</i>	A		8	8				20	Контрольная работа
<i>Промежуточный контроль</i>	A								Экзамен
ИТОГО:	108		12	12			36	48	

4.3. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам).

9 семестр

Модуль 1. Методология эконометрического исследования. Регрессионные эконометрические модели

Тема 1. Сущность эконометрической модели, её специфика в ряду экономико-математических моделей

Краткий исторический очерк развития эконометрики. Основные понятия и определения эконометрики. Модель. Связь эконометрики с другими дисциплинами. Сущность эконометрической модели; её специфика в ряду экономико-математических моделей. Причины существования случайной составляющей. Методология эконометрического исследования. Применение эконометрического моделирования в экономическом анализе.

Тема 2. Корреляционно-регрессионный анализ. Множественная и частная корреляция.

Корреляционно-регрессионный анализ. Модель парной регрессии. Подгонка кривой. Линейность по параметрам. Метод наименьших квадратов. Основные гипотезы существования эконометрической модели в виде парной регрессии. Нелинейность по параметрам. Линеаризация, особенности интерпретации параметров, коэффициенты эластичности. Проверка адекватности и точности уравнения регрессии.

Отбор факторных признаков при построении множественной регрессии. Показатели степени мультиколлинеарности. Отбор факторов при измерении макроэкономических показателей. Множественная и частная корреляция. Оценка параметров множественной регрессии. Проблемы гетероскедастичности. Построение эконометрических моделей в виде производственных функций (Кобба-Дугласа и др.).

Модуль 2. Эконометрические модели временных рядов.

Тема 3. Модели тренда. Моделирование циклических колебаний временного ряда.

Основные понятия в теории временных рядов. Цели, этапы и методы анализа временных рядов. Модели тренда и методы его выделения из временного ряда. Авторкорреляционная функция и её применение. Оценивание регрессии в условиях авторкорреляции ошибок. Модель авторегрессии ошибок первого порядка. Модели экономических циклов в рыночной экономике. Мультипликативная и аддитивная модель временного ряда и их применение. Фиктивные переменные для моделирования циклических колебаний временного ряда.

Тема 4. Виды прогноза. Доверительные интервалы прогноза. Прогнозирование динамических процессов на основе моделей тренда.

Тема 5. Макро и региональные эконометрические модели. Построение и применение региональных эконометрических моделей в анализе экономических проблем региона. Макроэконометрические модели и прогнозирование на их основе. Макроэкономические модели Кейнса. Региональные эконометрические модели.

А семестр

Модуль 1. Системы линейных одновременных уравнений.

Тема 1. Модели, представленные системами одновременных линейных уравнений (СОУ). Проблема идентификации. Методы оценивания. Инструментальные переменные. Косвенный и двухшаговый метод наименьших квадратов. Оценивание модели спроса-предложения.

Тема 2. Системы эконометрических уравнений: виды, применение. Методы решения систем одновременных уравнений.

Модуль 2. Динамические эконометрические модели.

Тема 3. Моделирование динамических процессов. Эконометрические модели панельных данных. Регрессионные динамические модели. Лаговые переменные. Авторегрессионные модели. Модели с распределенным лагом. Панельное представление данных. Нестационарность в динамических моделях взаимосвязи. Стохастические тренды. Прогнозирование по динамическим моделям.

Тема 4. Построение регрессионных моделей для анализа и прогнозирования экономических процессов региона. Построение и исследование систем эконометрических уравнений для региона.

5. Образовательные технологии

Образовательные технологии, используемые при реализации различных видов учебной работы по дисциплине «Эконометрика» предусматривают широкое использование в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий. Лекции с проблемным изложением проводятся с применением мультимедийного оборудования в виде презентаций. Данные лекции доступны для обучающихся при подготовке к разного вида контролю и СРС. Лекции-дискуссии, деловые игры (рассмотрение конкретной ситуации), конкретное обсуждение ситуаций.

В учебном процессе широко применяются компьютерные технологии. Поэтому все занятия проводятся в лаборатории, оборудованной ПК и мультимедийным оборудованием.

6. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов.

Самостоятельная работа студентов (СРС) включает контролируемую и внеаудиторную самостоятельную работу, направлена на повышение качества обучения, углубление и закрепление знаний студента, развитие аналитических навыков по проблематике учебной дисциплины, активизацию учебно-познавательной деятельности студентов и снижение аудиторной нагрузки. Часть программного материала

выносятся для самостоятельного внеаудиторного изучения с последующим текущим или итоговым контролем знаний на занятиях или экзамене. Контроль СРС и оценка ее результатов организуется как самоконтроль (самооценка) студента, а также как контроль и оценка со стороны преподавателя, например в ходе собеседования. Баллы, полученные по СРС студентом, обязательно учитываются при итоговой аттестации по курсу. Формы контроля СРС включают: тестирование; устную беседу по теме с преподавателем; выполнение индивидуального задания и др.

Роль студента в СРС - самостоятельно организовывать свою учебную работу по предложенному преподавателем, методически обеспеченному плану. СРС по курсу учитывает индивидуальные особенности слушателей и включает не только задания, связанные с решением типовых задач, но также творческие задания, требующие самостоятельно «добывать» знания из разных областей, группировать и концентрировать их в контексте конкретной решаемой задачи. Технология обучения предусматривает выработку навыков презентации результатов выполненного индивидуального задания и создание условий для командной работы над комплексной темой с распределением функций и ответственности между членами коллектива. Оценка результатов выполнения индивидуального задания осуществляется по критериям, известным студентам, отражающим наиболее значимые аспекты контроля за выполнением этого вида работ.

9 семестр

Наименование тем	Содержание самостоятельной работы	Форма контроля
Тема 1. Сущность эконометрической модели, её специфика в ряду экономико-математических моделей	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; подготовка реферата; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование
Тема 2. Корреляционно-регрессионный анализ. Множественная и частная корреляция	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; подготовка реферата; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование
Тема 3. Модели тренда. Моделирование циклических колебаний временного ряда	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; решение задач и тестов; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование, проверка заданий
Тема 4. Прогнозирование динамических процессов на основе моделей тренда	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; решение задач и тестов; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование, проверка заданий

Тема 5. Макро и региональные эконометрические модели	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; решение задач и тестов; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование, проверка заданий
--	--	---

А семестр

Наименование тем	Содержание самостоятельной работы	Форма контроля
Тема 1. Системы эконометрических уравнений: виды, применение	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; подготовка реферата; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование
Тема 2. Методы решения систем одновременных уравнений	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; подготовка реферата; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование
Тема 3. Моделирование динамических процессов. Эконометрические модели панельных данных	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; решение задач и тестов; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование, проверка заданий
Тема 4. Построение регрессионных моделей для анализа и прогнозирования экономических процессов региона. Построение и исследование систем эконометрических уравнений для региона	Изучение разделов дисциплины по учебной литературе, в том числе вопросов, не освещаемых на лекциях; решение задач и тестов; подготовка к контролю текущих знаний по дисциплине	Опрос, контрольное тестирование, проверка заданий

7. Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины.

7.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы.

Перечень компетенций с указанием этапов их формирования приведен в описании образовательной программы.

Компетен-	Знания, умения, навыки	Процедура освоения
-----------	------------------------	--------------------

ция		
ПК-3	<p>Знать: особенности эконометрического метода и измерений в экономике, методы и особенности эконометрического прогнозирования социально-экономических процессов</p> <p>Уметь: формировать прогнозы развития конкретных экономических процессов на микро- и макроуровне</p> <p>Владеть: методами количественного анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования</p>	Тестирование. Расчетно-графическое задание Мини-конференция
ПК-10	<p>Знать: современные программные продукты, необходимые для решения эконометрических задач</p> <p>Уметь: использовать современное программное обеспечение для решения эконометрических задач</p> <p>Владеть: компьютерными технологиями статистической обработки данных</p>	Устный опрос. Тестирование. Расчетно-графическое задание

7.2. Описание показателей и критериев оценивания компетенций, описание шкал оценивания.

ПК-3 - применять методы системного анализа и моделирования для анализа архитектуры предприятий

Уровень	Показатели (что обучающийся должен продемонстрировать)	Оценочная шкала		
		Удовлетворительно	Хорошо	Отлично
Пороговый	<p>Знать: особенности эконометрического метода и измерений в экономике, методы и особенности эконометрического прогнозирования социально-экономических процессов</p> <p>Уметь: формировать прогнозы развития конкретных экономических процессов на микро- и макроуровне</p> <p>Владеть: методами количественного анализа и моделирования, теоретического и экспериментального исследования</p>	<p>Ответ студента правилен в основных моментах, нет иллюстрирующих примеров, нет собственного мнения, есть ошибки в деталях. Бальное выражение: от 51 до 65.</p>	<p>Ответ студента правильный, но не полный. Не приведены иллюстрирующие примеры, обобщающее мнение студента не четко выражено. Бальное выражение: от 65 до 85.</p>	<p>Ответ студента полный и правильный. Студент способен обобщить материал, сделать собственные выводы, выразить свое мнение, привести примеры. Бальное выражение: от 86 до 100.</p>

ПК-10 - проводить исследования и поиск новых моделей и методов совершенство-

вания архитектуры предприятия

Уровень	Показатели (что обучающийся должен продемонстрировать)	Оценочная шкала		
		Удовлетворительно	Хорошо	Отлично
Пороговый	<p>Знать: современные программные продукты, необходимые для решения эконометрических задач</p> <p>Уметь: использовать современное программное обеспечение для решения эконометрических задач</p> <p>Владеть: компьютерными технологиями статистической обработки данных</p>	<p>Ответ студента правилен в основных моментах, нет иллюстрирующих примеров, нет собственного мнения, есть ошибки в деталях. Бальное выражение: от 51 до 65.</p>	<p>Ответ студента правильный, но не полный. Не приведены иллюстрирующие примеры, обобщающее мнение студента не четко выражено. Бальное выражение: от 65 до 85.</p>	<p>Ответ студента полный и правильный. Студент способен обобщить материал, сделать собственные выводы, выразить свое мнение, привести примеры. Бальное выражение: от 86 до 100.</p>

Если хотя бы одна из компетенций не сформирована, то положительная оценки по дисциплине быть не может.

7.3. Типовые контрольные задания

Примерные тестовые задания для текущего контроля и промежуточной аттестации.

- Кто является основателем эконометрики?
 - Р. Фриш и Я. Тинберген
 - Р. Фриш и В. Леонтьев
 - Л. Канторович и Т. Купманс.
 - П. Самуэльсон и Р. Клейн
- Когда было официально провозглашено о возникновении эконометрики?
 - в 1910 году
 - в 1931 году
 - в 1969 году
 - В 1980 году
- Когда в России стали изучать и использовать эконометрику?
 - в период перехода к рыночной экономике
 - в конце 50-х –
 - начале 60-х годов
 - в конце 60-х – начале 70-х
 - в первые годы советской власти
- Какой раздел экономической науки обычно сравнивают с эконометрикой?
 - экономическую теорию
 - математическую экономику
 - экономическую статистику
 - макроэкономику
- Какое определение соответствует понятию «эконометрика»?
 - это наука, предметом изучения которой является количественная сторона массовых социально-экономических явлений и процессов в конкретных условиях места и времени
 - это наука, предметом изучения которой является количественное выражение

взаимосвязей экономических явлений и процессов

в) это наука, предметом изучения которой являются общие закономерности случайных явлений и методы количественной оценки влияния случайных факторов

г) это наука, изучающая использование различного рода ограниченных ресурсов в целях обеспечения потребностей людей и отношения между различными сторонами, возникающие в процессе хозяйствования

6. Какова цель эконометрики?

а) представить экономические данные в наглядном виде

б) разработать способы моделирования и количественного анализа реальных экономических объектов

в) определить способы сбора и группировки статистических данных

г) изучить качественные аспекты экономических явлений

7. Связь называется корреляционной:

а) если каждому значению факторного признака соответствует вполне определенное неслучайное значение результативного признака

б) если каждому значению факторного признака соответствует множество значений результативного признака, т.е. определенное статистическое распределение

в) если каждому значению факторного признака соответствует целое распределение значений результативного признака

г) если каждому значению факторного признака соответствует строго определенное значение факторного признака.

8. Найдите верное высказывание. Эластичность показывает:

а) на сколько единиц изменится фактор x_k при изменении результирующего показателя y на 1 единицу

б) на сколько единиц изменится результирующий показатель y при изменении фактора x_k на 1 единицу

в) на сколько % изменится фактор x_k при изменении результирующего показателя y на 1 %

г) на сколько % изменится результирующий показатель y при изменении фактора x_k на 1 %

9. Какое предположение о матрице факторов X не является предпосылкой классической линейной регрессионной модели

а) Матрица факторов X – невырожденная (независимые переменные не коррелируют друг с другом).

б) Длина исходного ряда данных больше, чем количество факторов (достаточное число степеней свободы).

в) Матрица факторов X содержит все важнейшие факторы, определяющие изменения зависимой переменной.

г) Независимые переменные экзогенны.

10. Какое предположение о результирующем показателе является предпосылкой классической регрессионной модели?

а) Результирующий показатель является качественным, причем на него не накладываются особые ограничения.

б) Результирующий показатель измеряется в номинальной шкале.

- в) Результирующий показатель измеряется в порядковой шкале.
- г) Результирующий показатель является количественным, причем на него не накладываются особые ограничения.
11. Какое значение не может принимать парный коэффициент корреляции?
- а) -0,859
 б) 0,003
 в) 1,121
 г) 0,751
12. Критерий Стьюдента предназначен для
- а) определения статистической значимости каждого из коэффициентов уравнения регрессии.
 б) определения экономической значимости каждого из коэффициентов уравнения регрессии.
 в) определения статистической значимости модели в целом на основе совокупной достоверности всех ее коэффициентов.
 г) определения экономической значимости регрессионной модели в целом.
13. Что такое линеаризация?
- а) Процесс преобразования функции к линейному мультипликативному виду б) Процесс преобразования функции к линейному аддитивному виду
 в) Процесс преобразования функции к нелинейному аддитивному виду
 г) Процесс преобразования функции к нелинейному мультипликативному виду
14. Сколько методов линеаризации известны?
- а) 4 б) 3
 в) 2 г) Бесконечно много
15. Сколько классов нелинейных функций различают?
- а) 10 б) 3
 в) 6 г) 2
16. Какая нелинейная функция идентична кривой Филлипса?
- а) Логарифм б) Парабола
 в) Экспонента г) Равносторонняя гипербола
17. Какая нелинейная функция идентична кривой Энгеля?
- а) Экспонента б) Равносторонняя гипербола
 в) Неравносторонняя гипербола г) Логарифм
18. Какой коэффициент определяет среднее изменение результирующего признака при изменении факторного признака на 1%:
- а) коэффициент регрессии б) коэффициент детерминации
 в) коэффициент корреляции г) коэффициент эластичности
19. Аддитивная модель ряда динамики представляет собой:
- а) $y_t = u_t + v_t + \varepsilon_t$
 б) $y_t = u_t \cdot v_t \cdot \varepsilon_t$
 в) $y_t = u_t + v_t \cdot \varepsilon_t$
 г) $y_t = u_t \cdot v_t + \varepsilon_t$
20. Мультипликативная модель ряда динамики представляет собой:
- а) $y_t = u_t \cdot v_t \cdot \varepsilon_t$ $y_t = u_t + v_t + \varepsilon_t$

в) $y_t = u_t + v_t \cdot \varepsilon_t$ $y_t = u_t \cdot v_t + \varepsilon_t$

21. Укажите правильную характеристику параметра к экспоненциального тренда

- а) среднее изменение анализируемого явления от периода (момента) к периоду (моменту) времени
- б) среднее ускорение изменения анализируемого явления от периода (момента) к периоду (моменту) времени
- в) средний выровненный уровень ряда для периода (момента) времени, принятого за начало отсчета
- г) постоянный цепной темп изменения уровней временного ряда.

22. Случайная составляющая в модели $y_t = u_t + v_t + \varepsilon_t$ обозначена

- а) u_t б) ε_t
- в) y_t г) v_t

23. Для чего проводят коррелирование отклонений от выровненных уровней тренда?

- а) для определения тесноты связи между отклонениями фактических уровней от выровненных, отражающих тренд
- б) для определения тесноты связи между рядами динамики в случаи отсутствия автокорреляции
- в) для исключения влияния автокорреляции
- г) для исключения влияния общей тенденции на колеблемость признака

24. В каком случаи присутствует явление коинтеграции?

- а) если во временном ряду присутствует постоянный средний темп роста анализируемого показателя
- б) если ряд имеет постоянную дисперсию в длительном промежутке времени
- в) если во временном ряду совпадают (или имеют противоположное направление) тенденции двух и более уровней
- г) если во временном ряду присутствует постоянный цепной темп изменения уровней временного ряда

25. Системами эконометрических уравнений являются:

- а) системы одновременных уравнений
- б) системы рекурсивных уравнений
- в) системы нормальных уравнений
- г) системы независимых уравнений

26. Система одновременных уравнений отличается от других видов эконометрических систем тем, что в ней:

- а) эндогенная переменная одного уравнения находится в другом уравнении системы в качестве фактора
- б) одни и те же эндогенные переменные системы в одних уравнениях находятся в левой части, а в других уравнениях – в правой части
- в) каждая эндогенная переменная является функцией одной и той же совокупности экзогенных переменных
- г) каждая экзогенная переменная является функцией одной и той же совокупности экзогенных переменных

27. МНК позволяет получить состоятельные и несмещенные оценки параметров системы:

- а) рекурсивных уравнений б) одновременных уравнений
 в) независимых уравнений г) нормальных уравнений
28. Экзогенные переменные модели характеризуются тем, что они:
 а) датируются предыдущими моментами времени
 б) являются независимыми и определяются вне системы
 в) являются зависимыми и определяются внутри системы
 г) являются независимыми и определяются внутри системы
- 29 Выберите аналог понятия «эндогенная переменная»:
 а) результат
 б) фактор
 в) зависимая переменная, определяемая внутри системы
 г) предопределенная переменная
30. Если структурные коэффициенты модели выражены через приведенные коэффициенты и имеют более одного числового значения, то такая модель:
 а) сверхидентифицируемая б) неидентифицируемая
 в) идентифицируемая г) квазиидентифицируемая

Вопросы для зачета

1. История развития эконометрики.
2. Роль экономистов-лауреатов премии Нобеля в появлении и развитии эконометрики.
3. Связь эконометрики с другими научными дисциплинами
4. Содержание основных этапов процесса эконометрического моделирования
5. Классификация переменных в эконометрических моделях.
6. Статистическая база эконометрических моделей.
7. Понятия регрессии, функции регрессии, уравнения регрессии.
8. Модель парной регрессии. Подгонка кривой.
9. Множественная регрессия.
10. Линейная регрессия.
11. Нелинейная регрессия.
12. Статистические характеристики эконометрической модели и их интерпретация.
13. Метод наименьших квадратов оценки параметров уравнения регрессии.
14. Проверка гипотез о значимости параметров регрессии, коэффициента и уравнения регрессии в целом.
15. Теорема Гаусса-Маркова и её роль в построении эконометрической модели.
16. Смысл отдельных составляющих уравнения регрессии.
17. Временной ряд и его составляющие.
18. Моделирование временных рядов.
19. Аддитивная и мультипликативная модель временного ряда.
20. Моделирование тенденции временного ряда.
21. Выявление сезонной компоненты во временном ряду.
22. Выявление случайной компоненты во временном ряду.

Вопросы для экзамена

23. Понятие автокорреляции и авторегрессии временного ряда. Виды автокорреляции.
24. Выявление автокорреляции остатков по критерию Дарбина-Уотсона.
25. Характеристика моделей с распределенным лагом и оценка их параметров.
26. Характеристика авторегрессионных моделей. Метод Койка.
27. Выбор формы модели с распределенным лагом.
28. Лаговые модели Алмон.
29. Оценка параметров моделей авторегрессии методом инструментальной переменной.
30. Линейные модели панельных данных и их параметры
31. Спецификации моделей с фиксированными и случайными эффектами, их особенности.
32. Общие понятия о системе одновременных уравнений.
33. Формы представления системы одновременных уравнений.
34. Задача идентификации уравнений системы. Необходимое и достаточное условие идентифицируемости системы одновременных уравнений.
35. Косвенный метод наименьших квадратов решения системы одновременных уравнений и условия его применения.
36. Двухшаговый метод наименьших квадратов решения системы одновременных уравнений.
37. Трёхшаговый метод наименьших квадратов решения системы одновременных уравнений.

7.4. Методические материалы, определяющие процедуру оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций.

Общий результат выводится как интегральная оценка, складывающаяся из текущего контроля - 60% и промежуточного контроля - 40%.

Текущий контроль по дисциплине включает:

- посещение занятий - 10 баллов,
- участие на практических занятиях - 20 баллов,
- выполнение лабораторных заданий - 35 баллов,
- выполнение домашних (аудиторных) контрольных работ - 35 баллов.

Промежуточный контроль по дисциплине включает:

- устный опрос - 20 баллов,
- письменная контрольная работа - 40 баллов,
- тестирование - 40 баллов.

8. Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины.

а) основная:

1. Елисеева И.И. Курышева С.В. Нерадовская Ю.В. Эконометрика: Учебник. – М.: Проспект, 2011. – 288 с.

2. Кремер Н. Ш., Путко Б. А. Эконометрика: Учебник для вузов.- М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2008.- 311 с.
3. Магнус Я.Р., Катышев П.К., Пересецкий А.А. Эконометрика. Начальный курс. Учебное пособие. 8-е исправленное издание. - М.: Издательство "Дело", 2007. - 504 с

б) дополнительная:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.
2. Эконометрика: Учебник / Мхитарян В.С. Архипова М.Ю. Балаш В.А.; под ред. Мхитарян В.С. – М.: Проспект, 2010.- 384 с.
3. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. - Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.
4. Айвазян С. А. Основы эконометрики. Учебник для вузов. Т.2. – М.:ЮНИТИ-ДАНА, 2001. – 432 с.
5. Айвазян С. А., Иванова С. С. Эконометрика: учебное пособие. – М.: Маркет ДС Корпорейшн, 2010. –104 с.
6. Бывшев В.А. Эконометрика. – М.: Финансы и статистика 2008. – 480с.
7. Введение в эконометрику: Учебное пособие для вузов Яновский Л.П. Буховец А.Г.; под ред. Яновского Л.П. Изд. 2-е, испр., доп. – М.: Кнорус, 2010. – 256 с.
8. Новиков А.И. Эконометрика: Учебное пособие для вузов Изд. 2-е, испр., доп. – М.: Инфра-М, 2011. –144 с.
9. Эконометрика: Учебник для вузов / под ред. Мхитаряна В.С. – М.: Проспект, 2008. – 384 с.

9. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», необходимых для освоения дисциплины.

1. Информационные базы данных (по профилю образовательных программ) на Сайте Росстата [Электронный ресурс] – Режим доступа: gks.ru.
2. Прикладная эконометрика. Научно-практический журнал [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://appliedeconometrics.cemi.rssi.ru/>.
3. Центр макроэкономического анализа и прогнозирования при ИНП РАН [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.forecast.ru>
4. Центр экономической конъюнктуры при правительстве РФ [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.cea.gov.ru>
5. Центральный экономико-математический институт (ЦЭМИ) РАН [Электронный ресурс] – Режим доступа: <http://www.cemi.rssi.ru> .
6. Эконометрика: Учебник для магистров. Елисеева И.И.. М.: Юрайт, 2014 – Режим доступа: <http://lib2.sseu.ru/MegaPro/Web/Search/Simple>
7. Электронный учебник Statsoft [Электронный ресурс]. – Режим доступа: www.statsoft.ru/home/textbook/.

10. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины.

Для изучения теоретического курса студентам необходимо использовать лекционный материал, учебники и учебные пособия из списка основной и дополнительной литературы, интернет источники.

По дисциплине «Эконометрика» в конце каждого модуля проводится контрольная работа.

В контрольную работу включаются теоретические вопросы и задачи тех типов, которые были разобраны на предшествующих практических занятиях.

Рабочей программой дисциплины «Эконометрика» предусмотрена самостоятельная работа студентов в объеме 48 часов. Самостоятельная работа проводится с целью углубления знаний по дисциплине и предусматривает:

- чтение студентами рекомендованной литературы и усвоение теоретического материала дисциплины;

- подготовку к практическим занятиям;

- выполнение индивидуальных заданий;

- подготовку к контрольным работам, зачету и экзаменам.

С самого начала изучения дисциплины студент должен четко уяснить, что без систематической самостоятельной работы успех невозможен. Эта работа должна регулярно начинаться сразу после лекционных и практических занятий, для закрепления только что пройденного материала.

После усвоения теоретического материала можно приступить к самостоятельному решению задач из учебников и пособий, входящих в список основной литературы.

11. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине, включая перечень программного обеспечения и информационных справочных систем.

Интернет-ресурсы, мульти-медиа, электронная почта для коммуникации со студентами, Excel Microsoft, Power Point.

12. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине.

Компьютерный класс, оборудованный для проведения лекционных и практических занятий средствами оргтехники, персональными компьютерами, объединенными в сеть с выходом в Интернет; установленное лицензионное и свободное программное обеспечение.

Приложение
План семинарских занятий

9 семестр

Модуль 1. Методология эконометрического исследования. Регрессионные эконометрические модели.

Тема 1. Сущность эконометрической модели, её специфика в ряду экономико-математических моделей.

1. Предмет и задачи эконометрики.
2. Методология эконометрического исследования.
3. Применение эконометрического моделирования в экономическом анализе.

Литература:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.
2. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. - Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.
3. Магнус Я.Р., Катышев П.К., Пересецкий А.А. Эконометрика. Начальный курс. Учебное пособие. 8-е исправленное издание. - М.: Издательство "Дело", 2007. - 504 с
4. Практикум по эконометрике. Под редакцией И.И. Елисеевой. – М.: Финансы и статистика, 2001.-192 с.

Тема 2. Корреляционно-регрессионный анализ. Множественная и частная корреляция.

1. Линейная регрессия сущность, оценка параметров. Определение тесноты связи и оценка существенности уравнения линейной регрессии.
2. Нелинейность по параметрам. Линеаризация, особенности интерпретации параметров, коэффициенты эластичности.
3. Отбор факторных признаков при построении множественной регрессии. Множе-

ственная и частная корреляция.

Литература:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.
2. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. – Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.
3. Елисеева И.И. Курышева С.В. Нерадовская Ю.В. Эконометрика: Учебник. – М.: Проспект, 2011. – 288 с.
4. Практикум по эконометрике. Под редакцией И.И. Елисеевой. – М.: Финансы и статистика, 2001.-192 с.

Модуль 2. Эконометрические модели временных рядов

Тема 3. Модели тренда. Моделирование циклических колебаний временного ряда.

1. Цели, этапы и методы анализа временных рядов. Сглаживание временных рядов.
2. Автокорреляционная функция. Коррелограмма.
3. Автокорреляция в остатках. Критерий Дарбина-Уотсона.
4. Моделирование тенденций временного ряда. Фиктивные переменные для моделирования циклических колебаний временного ряда.

Литература:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.
2. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. – Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.
3. Эконометрика: Учебник для вузов / под ред. Мхитаряна В.С. – М.: Проспект, 2008. – 384 с.
4. Практикум по эконометрике. Под редакцией И.И. Елисеевой. – М.: Финансы и статистика, 2001.-192 с.

Тема 4. Прогнозирование динамических процессов на основе моделей тренда

1. Доверительные интервалы прогноза.
- 2.

Тема 5. Макро и региональные эконометрические модели

1. Макроэконометрические модели.
2. Сущность и особенности региональных эконометрических моделей.
3. Филадельфийская модель региональной экономики.

Литература:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.
2. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. – Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.
3. Елисеева И.И. Курышева С.В. Нерадовская Ю.В. Эконометрика: Учебник. – М.: Проспект, 2011. – 288 с.

А семестр

Модуль 1. Системы линейных одновременных уравнений.

Тема 1. Системы эконометрических уравнений: виды, применение

1. Понятие о системах эконометрических уравнений.

2. Проблема идентификации модели.

Литература:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.

2. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. – Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.

3. Елисеева И.И. Курышева С.В. Нерадовская Ю.В. Эконометрика: Учебник. – М.: Проспект, 2011. – 288 с.

Тема 2. Методы решения систем одновременных уравнений.

1. Структурная и приведенная формы системы одновременных уравнений.

2. Методы оценки параметров одновременных уравнений.

Литература:

1. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.

2. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. – Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.

3. Елисеева И.И. Курышева С.В. Нерадовская Ю.В. Эконометрика: Учебник. – М.: Проспект, 2011. – 288 с.

Модуль 2. Динамические эконометрические модели. Построение эконометрических моделей для изучения и анализа региональной экономики.

Тема 3. Моделирование динамических процессов. Эконометрические модели панельных данных.

1. Моделирование динамических процессов.

2. Регрессионные динамические модели.

Литература:

4. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.

5. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. – Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.

6. Кремер Н. Ш., Путко Б. А. Эконометрика: Учебник для вузов.- М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2008.- 311 с.

Тема 4. Построение регрессионных моделей для анализа и прогнозирования экономических процессов региона. Построение и исследование систем эконометрических уравнений для региона.

1. Особенности эконометрического прогнозирования.
2. Прогнозирование на основе моделей временных рядов.

Литература:

7. Тихомиров Н. П., Дорохина Е. Ю. Эконометрика: Учебник для вузов. – М.: Экзамен, 2007. – 512 с.
8. Адамадзиев К. Р., Джаватов Д. К. Эконометрика. Краткий курс: учебное пособие. - Махачкала: Изд. Дом «Народы Дагестана», 2003. – 83с.
9. Елисеева И.И. Курышева С.В. Нерадовская Ю.В. Эконометрика: Учебник. – М.: Проспект, 2011. – 288 с.