

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Отделение развития территорий



УТВЕРЖДАЮ

Проректор
по образовательной деятельности КФУ
Проф. Минзарипов Р.Г.

"__" _____ 20__ г.

Программа дисциплины
Эконометрика Б2.В.3

Направление подготовки: 081100.62 - Государственное и муниципальное управление

Профиль подготовки: Региональное управление

Квалификация выпускника: бакалавр

Форма обучения: очное

Язык обучения: русский

Автор(ы):

Балашова Е.Я.

Рецензент(ы):

Астафьева Л.К.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой: Кундакчян Р. М.

Протокол заседания кафедры No ___ от "___" _____ 201__ г

Учебно-методическая комиссия Института управления, экономики и финансов (отделение развития территорий):

Протокол заседания УМК No ___ от "___" _____ 201__ г

Регистрационный No

Казань
2015

Содержание

1. Цели освоения дисциплины
2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы
3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля
4. Структура и содержание дисциплины/ модуля
5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения
6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов
7. Литература
8. Интернет-ресурсы
9. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

Программу дисциплины разработал(а)(и) доцент, к.н. (доцент) Балашова Е.Я. кафедра экономической теории Общеэкономическое отделение , Elizaveta.Balashova@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Целью изучения дисциплины "Эконометрика" является формирование у студентов знаний и навыков, необходимых для применения математических методов при проведении анализа социально-экономических процессов, финансовых и управленческих моделей.

2. Место дисциплины в структуре основной образовательной программы высшего профессионального образования

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б2.В.3 Общепрофессиональный" основной образовательной программы 081100.62 Государственное и муниципальное управление и относится к вариативной части. Осваивается на 3 курсе, 5 семестр.

Дисциплина "Эконометрика" является логическим продолжением ряда курсов, изученных студентами ранее, таких как "Теория управления", "Микроэкономика", "Макроэкономика" и т.д. В результате освоения дисциплины "Эконометрика" студенты смогут применить полученные теоретические и практические знания при прохождении производственной практики и подготовке отчета по практике, а также при написании дипломной работы.

3. Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины /модуля

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

| Шифр компетенции | Расшифровка приобретаемой компетенции |
|---|---|
| ОК-8 (общекультурные компетенции) | владением основными способами и средствами информационного взаимодействия, получения, хранения, переработки, интерпретации информации, наличием навыков работы с информационно-коммуникационными технологиями; способностью к восприятию и методическому обобщению информации, постановке цели и выбору путей ее достижения |
| ПК-26 (профессиональные компетенции) | способностью применять информационно-коммуникационные технологии в профессиональной деятельности с видением их взаимосвязей и перспектив использования |

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

- классификацию методов моделирования;
- сущность математического моделирования экономико-социальных рядов;
- экономический смысл уравнений регрессии;
- основные направления развития эконометрического анализа.

2. должен уметь:

- ориентироваться в сложных взаимодействиях экономических факторов;
- применять методы корреляционно-регрессионного анализа для анализа статических и динамических рядов;

- строить эконометрические модели перекрестных и временных рядов, оценивать их адекватность и точность, делать прогнозы на основе этих моделей;
- стоить алгоритмы решения задач математического моделирования и находить их решение с применением средств электронных таблиц и специализированных математических пакетов.

3. должен владеть:

- навыками построения и анализа регрессионных моделей в экономике;
 - инструментальными средствами специализированных математических пакетов, электронных таблиц для решения задач математического моделирования.
- применять полученные теоретические знания на практике.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных(ые) единиц(ы) 108 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины зачет в 5 семестре.

Суммарно по дисциплине можно получить 100 баллов, из них текущая работа оценивается в 50 баллов, итоговая форма контроля - в 50 баллов. Минимальное количество для допуска к зачету 28 баллов.

86 баллов и более - "отлично" (отл.);

71-85 баллов - "хорошо" (хор.);

55-70 баллов - "удовлетворительно" (удов.);

54 балла и менее - "неудовлетворительно" (неуд.).

4.1 Структура и содержание аудиторной работы по дисциплине/ модулю

Тематический план дисциплины/модуля

| N | Раздел Дисциплины/ Модуля | Семестр | Неделя семестра | Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах) | | | Текущие формы контроля |
|----|---|---------|--------------------|---|-------------------------|------------------------|---------------------------|
| | | | | Лекции | Практические занятия | Лабораторные работы | |
| 1. | Тема 1. Основные понятия и определения эконометрики | 5 | 1-2 | 4 | 4 | 0 | |
| 2. | Тема 2. Классическая модель парной регрессии и метод наименьших квадратов | 5 | 3-4 | 4 | 4 | 0 | письменная работа |
| 3. | Тема 3. Линейная модель множественной регрессии | 5 | 5-6 | 4 | 4 | 0 | |

| N | Раздел Дисциплины/ Модуля | Семестр | Неделя семестра | Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах) | | | Текущие формы контроля |
|----|--|---------|--------------------|---|-------------------------|------------------------|---------------------------|
| | | | | Лекции | Практические занятия | Лабораторные работы | |
| 4. | Тема 4. Обобщенная модель множественной регрессии | 5 | 7-8 | 4 | 4 | 0 | контрольная работа |
| 5. | Тема 5. Некоторые модели и методы регрессионного анализа, выходящие за рамки обобщенной модели множественной регрессии | 5 | 9-10 | 4 | 4 | 0 | |
| 6. | Тема 6. Система линейных одновременных уравнений (СЛОУ) | 5 | 11-12 | 4 | 4 | 0 | устный опрос |
| 7. | Тема 7. Анализ временных рядов | 5 | 13-14 | 2 | 4 | 0 | |
| | Тема . Итоговая форма контроля | 5 | | 0 | 0 | 0 | зачет |
| | Итого | | | 26 | 28 | 0 | |

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Основные понятия и определения эконометрики

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Эконометрика и ее место в ряду экономико-математических дисциплин. Виды эконометрических моделей, простейшие примеры эконометрических моделей. Типы данных.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Общие принципы построения и использования эконометрических моделей и методов в экономических исследованиях.

Тема 2. Классическая модель парной регрессии и метод наименьших квадратов

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Метод наименьших квадратов (МНК). Статистические свойства оценок МНК. Теорема Гаусса-Маркова. Оценка дисперсии ошибок. Показатели качества регрессии. Проверка гипотез, относящихся к коэффициентам регрессии.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Прогнозирование с помощью уравнения линейной регрессии.

Тема 3. Линейная модель множественной регрессии

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Основные характеристики линейной модели множественной регрессии. Метод наименьших квадратов. Мультиколлинеарность. Статистические свойства МНК-оценок, анализ качества и интерпретация построенного уравнения регрессии.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Построение модели множественной регрессии теоретических значений динамики ВВП, определение средней ошибки аппроксимации.

Тема 4. Обобщенная модель множественной регрессии

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Обобщенная модель множественной регрессии и обобщенный МНК. Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками. Гетероскедастичность и ее последствия. Обнаружение гетероскедастичности. Автокорреляция и связанные с ней факторы. Обнаружение автокорреляции первого порядка: критерий Дарбина-Уотсона.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Автокорреляция с лаговой зависимой переменной. Автокорреляция как следствие неправильной спецификации модели.

Тема 5. Некоторые модели и методы регрессионного анализа, выходящие за рамки обобщенной модели множественной регрессии

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Нелинейные модели регрессии и их линеаризация. Регрессионные модели с переменной структурой (использование фиктивных переменных). Стандартные ошибки и проверка гипотез. Множественные совокупности фиктивных переменных.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Обнаружение и устранение гетероскедастичности и автокорреляции остатков регрессии.

Тема 6. Система линейных одновременных уравнений (СЛОУ)

лекционное занятие (4 часа(ов)):

Определение и сущность модели, задаваемой системой линейных одновременных уравнений (СЛОУ). Классификация переменных и основные задачи статистического анализа СЛОУ. Проблемы спецификации СЛОУ. Общие сведения об основных методах статистического оценивания параметров СЛОУ.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

Тема 7. Анализ временных рядов

лекционное занятие (2 часа(ов)):

Временной ряд и его основные характеристики. Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их идентификация. Тренды, экономические циклы, сезонные колебания, псевдопериодические составляющие временного ряда.

практическое занятие (4 часа(ов)):

Методы анализа временных рядов.

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

| N | Раздел Дисциплины | Семестр | Неделя семестра | Виды самостоятельной работы студентов | Трудоемкость (в часах) | Формы контроля самостоятельной работы |
|----|---|---------|-----------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------|
| 2. | Тема 2. Классическая модель парной регрессии и метод наименьших квадратов | 5 | 3-4 | подготовка к письменной работе | 10 | письменная работа |
| 3. | Тема 3. Линейная модель множественной регрессии | 5 | 5-6 | подготовка домашнего задания | 6 | проверка домашнего задания |
| 4. | Тема 4. Обобщенная модель множественной регрессии | 5 | 7-8 | подготовка к контрольной работе | 10 | контрольная работа |

| N | Раздел Дисциплины | Семестр | Неделя семестра | Виды самостоятельной работы студентов | Трудоемкость (в часах) | Формы контроля самостоятельной работы |
|----|--|---------|-----------------|---------------------------------------|------------------------|---------------------------------------|
| 5. | Тема 5. Некоторые модели и методы регрессионного анализа, выходящие за рамки обобщенной модели множественной регрессии | 5 | 9-10 | подготовка домашнего задания | 8 | проверка домашнего задания |
| 6. | Тема 6. Система линейных одновременных уравнений (СЛОУ) | 5 | 11-12 | подготовка к устному опросу | 12 | устный опрос |
| 7. | Тема 7. Анализ временных рядов | 5 | 13-14 | подготовка домашнего задания | 8 | проверка домашнего задания |
| | Итого | | | | 54 | |

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

В процессе изучения дисциплины "Эконометрика" студенты решают практические задачи, связанные с построением регрессионных уравнений, проверкой качества уравнения, построением и оценкой нелинейных регрессионных моделей, а также выступают со стендовыми докладами. До 50% лекционных и практических занятий проходят с использованием презентаций MS PowerPoint.

6. Оценочные средства для текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации по итогам освоения дисциплины и учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы студентов

Тема 1. Основные понятия и определения эконометрики

Тема 2. Классическая модель парной регрессии и метод наименьших квадратов

письменная работа , примерные вопросы:

Решение задач на проверку гипотез и определение доверительных интервалов для параметров a и b модели парной регрессии, расчет коэффициента детерминации и F -статистики, анализ показателей качества регрессии по этим величинам. Прогнозирование в модели парной регрессии.

Тема 3. Линейная модель множественной регрессии

проверка домашнего задания, примерные вопросы:

Построение модели множественной регрессии теоретических значений динамики ВВП, определение средней ошибки аппроксимации.

Тема 4. Обобщенная модель множественной регрессии

контрольная работа , примерные вопросы:

Решение задач на оценивание вектора коэффициентов b и дисперсии ошибок в модели множественной регрессии.

Тема 5. Некоторые модели и методы регрессионного анализа, выходящие за рамки обобщенной модели множественной регрессии

проверка домашнего задания, примерные вопросы:

Обнаружение и устранение гетероскедастичности и автокорреляции остатков регрессии.

Тема 6. Система линейных одновременных уравнений (СЛОУ)

устный опрос , примерные вопросы:

1. Системы одновременных уравнений. 2. Экзогенные и эндогенные переменные. 3. Внешне не связанные уравнения. 4. Структурная и приведенная формы модели. 5. Косвенный метод наименьших квадратов. 6. Проблемы идентифицируемости. 7. Оценивание систем одновременных уравнений. 8. Двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

Тема 7. Анализ временных рядов

проверка домашнего задания, примерные вопросы:

Методы анализа временных рядов.

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к зачету:

1. Понятие о функциональной, статистической и корреляционной связях.
2. Основные задачи прикладного корреляционно-регрессионного анализа.
3. Уравнение регрессии, его смысл и назначение.
4. Выбор типа математической функции при построении уравнения регрессии.
5. Парная регрессия. Метод наименьших квадратов и условия его применения для определения параметров уравнения парной регрессии.
6. Оценка степени тесноты связи между количественными переменными.
7. Коэффициент ковариации.
8. Показатели корреляции: линейный коэффициент корреляции, индекс корреляции, теоретическое корреляционное отношение.
9. Коэффициент детерминации.
10. Стандартная ошибка уравнения регрессии.

Полный перечень вопросов к экзамену приведен в приложении 1.

7.1. Основная литература:

1. Эконометрика: учебник / под ред. И.И. Елисеевой. - 2-е изд., перераб. и доп.. - М.: Финансы и статистика, 2008. - 574 с.
2. Эконометрика: Учебное пособие /А.И. Новиковю-2-е изд, испр. и доп.-М.ИНФРА-М, 2011.-144с. <http://www.znaniyum.com/bookread.php?book=255726>
3. Эконометрика: Учебное пособие /Л.Е. Басовский.-М.: РИОР 2011.-48с. <http://www.znaniyum.com/bookread.php?book=308169>
4. Методы эконометрики Учебник С.А. Айвазян, московская школа экономики МГУ им. М.В. Ломоносова (МШЭ)-М. Магистр ИНФРА-М, 2010-512с. <http://www.znaniyum.com/bookread.php?book=196548>

7.2. Дополнительная литература:

1. Костромин А. В. Эконометрика: курс лекций / А. В. Костромин; Ин-т экономики, управления и права (г. Казань). - Казань: "Таглитат" ИЭУиП, 2004.?135 с.:
2. Домбровский В. В. Эконометрика: учебник / В.В. Домбровский; Федер. агентство по образованию, Нац. фонд подгот. кадров. - М: Новый учеб., 2004. - 342 с.
3. Салманов О.Н. Эконометрика / О. Н. Салманов. - М.: Экономистъ, 2006. - 320 с.:
4. Аистов А.В. Эконометрика шаг за шагом: для студ.высш.учеб.заведений / А. В. Аистов, А. Г. Максимов. - М.: Изд.дом ГУ ВШЭ, 2006. - 178 с.
5. Валентинов В.А. Эконометрика: учебник для студ. вузов / В. А. Валентинов. - М.: Дашков и К, 2006. - 448 с.

7.3. Интернет-ресурсы:

Официальный сайт журнала - <http://lib.ieie.nsc.ru/Magazin/Rr5.htm>

Официальный сайт журнала - http://creativeconomy.ru/mag_rp

Официальный сайт журнала - <http://www.kommersant.ru/sf>

Официальный сайт журнала - <http://expert.ru/expert>

Официальный сайт журнала - <http://www.profiz.ru/se>

Официальный сайт журнала - <http://economist.com.ru>

Официальный сайт журнала - <http://www.inesnet.ru/magazine>

Официальный сайт экономического журнала Высшей школы экономики - http://www.hse.ru/journals/journals_econom.shtml

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины(модуля)

Освоение дисциплины "Эконометрика" предполагает использование следующего материально-технического обеспечения:

Мультимедийная аудитория, вместимостью более 60 человек. Мультимедийная аудитория состоит из интегрированных инженерных систем с единой системой управления, оснащенная современными средствами воспроизведения и визуализации любой видео и аудио информации, получения и передачи электронных документов. Типовая комплектация мультимедийной аудитории состоит из: мультимедийного проектора, автоматизированного проекционного экрана, акустической системы, а также интерактивной трибуны преподавателя, включающей тач-скрин монитор с диагональю не менее 22 дюймов, персональный компьютер (с техническими характеристиками не ниже Intel Core i3-2100, DDR3 4096Mb, 500Gb), конференц-микрофон, беспроводной микрофон, блок управления оборудованием, интерфейсы подключения: USB, audio, HDMI. Интерактивная трибуна преподавателя является ключевым элементом управления, объединяющим все устройства в единую систему, и служит полноценным рабочим местом преподавателя. Преподаватель имеет возможность легко управлять всей системой, не отходя от трибуны, что позволяет проводить лекции, практические занятия, презентации, вебинары, конференции и другие виды аудиторной нагрузки обучающихся в удобной и доступной для них форме с применением современных интерактивных средств обучения, в том числе с использованием в процессе обучения всех корпоративных ресурсов. Мультимедийная аудитория также оснащена широкополосным доступом в сеть интернет. Компьютерное оборудование имеет соответствующее лицензионное программное обеспечение.

Компьютерный класс, представляющий собой рабочее место преподавателя и не менее 15 рабочих мест студентов, включающих компьютерный стол, стул, персональный компьютер, лицензионное программное обеспечение. Каждый компьютер имеет широкополосный доступ в сеть Интернет. Все компьютеры подключены к корпоративной компьютерной сети КФУ и находятся в едином домене.

Проекторное оборудование, используемое для проведения презентаций.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 081100.62 "Государственное и муниципальное управление" и профилю подготовки Региональное управление .

Автор(ы):

Балашова Е.Я. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Астафьева Л.К. _____

"__" _____ 201__ г.