

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное автономное учреждение
высшего профессионального образования
"Казанский (Приволжский) федеральный университет"
Центр заочного обучения и профессиональной переподготовки кадров с высшим образованием (второе высшее)



УТВЕРЖДАЮ

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

_____ 20__ г.

Программа дисциплины
Эконометрика БЗ.Б.3

Направление подготовки: 080100.62 - Экономика
Профиль подготовки: Бухгалтерский учет, анализ и аудит
Квалификация выпускника: бакалавр
Форма обучения: на базе СПО
Язык обучения: русский

Автор(ы):

Исмагилов И.И. , Кадочникова Е.И. , Кундакчян Р.М.

Рецензент(ы):

Костромин А.В.

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий(ая) кафедрой:

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

Учебно-методическая комиссия Института экономики и финансов (центра заочного обучения и профессиональной переподготовки кадров с высшим образованием (второе высшее)):

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

Регистрационный No

Казань
2014

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) заведующий кафедрой, д.н. (профессор) Исмагилов И.И. Кафедра статистики,эконометрики и естествознания общеэкономическое отделение , Ilyas.Ismagilov@kpfu.ru ; доцент, к.н. (доцент) Кадочникова Е.И. Кафедра статистики,эконометрики и естествознания общеэкономическое отделение , EIKadochnikova@kpfu.ru ; доцент, д.н. (доцент) Кундакчян Р.М. кафедра общеэкономических дисциплин отделение управления территориями , Rezeda.Kundakchyan@kpfu.ru

1. Цели освоения дисциплины

Цель изучения дисциплины - обучение студентов теоретическим основам эконометрической методологии и практическим навыкам применения эконометрических методов для исследования экономических закономерностей и взаимосвязей между экономическими переменными.

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

Данная учебная дисциплина включена в раздел " Б3.Б.3 Профессиональный" основной образовательной программы 080100.62 Экономика и относится к базовой (общепрофессиональной) части. Осваивается на 1, 2 курсах, 2, 3 семестры.

Изучению дисциплины "Эконометрика" предшествует освоение следующих дисциплин: "Математический анализ", "Теория вероятностей и математическая статистика", "Линейная алгебра", "Микроэкономика", "Макроэкономика", "Статистика".

Данная дисциплина способствует освоению следующих дисциплин: "Анализ финансовой отчетности", "Стратегическое планирование", "Экономический анализ в отраслях народного хозяйства" (профиль: бухгалтерский учет, анализ и аудит); "Анализ и моделирование трудовых показателей", "Экономический анализ" (профиль: экономика труда); "Бизнес-планирование", "Антикризисное управление", "Стратегический анализ", "Экономический анализ" (профиль: экономика предприятий и организаций); "Бюджетное планирование и прогнозирование", "Экономический анализ банковской деятельности", "Моделирование и анализ рынка ценных бумаг" (профиль: финансы и кредит); "Управление финансовыми рисками", "Планирование и прогнозирование в налогообложении", "Экономический анализ" (профиль: налоги и налогообложение).

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

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции:

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК - 13 (общекультурные компетенции)	владение основными методами, способами и средствами получения, хранения, переработки информации, навыками работы с компьютером как средством управления информацией на основе знания типов эконометрических моделей, методов оценки их параметров и умения проводить отбор адекватной модели с помощью специальных программных продуктов
ОК - 4 (общекультурные компетенции)	способность анализировать социально-значимые проблемы и процессы, происходящие в обществе, и прогнозировать возможное их развитие в будущем благодаря владению навыками построения эконометрических моделей и умению их экономической интерпретации

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ОК -11 (общекультурные компетенции)	осознание социальной значимости своей будущей профессии, обладание высокой мотивацией к выполнению профессиональной деятельности в результате применения эконометрических моделей в принятии управленческих решений
ПК-1 (профессиональные компетенции)	способность собирать и анализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на основе знания типов данных, предпосылок МНК
ПК-2 (профессиональные компетенции)	способность на основе типовых методик и действующей норматив-но-правовой базы рассчитать экономические и социально-экономические показатели, характеризующие деятельность хозяйствующих субъектов благодаря знанию методов эконометрического анализа
ПК - 8 (профессиональные компетенции)	способность анализировать и интерпретировать данные отечественной и зарубежной статистики о социально-экономических процессах и явлениях, выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей в результате умения экономически интерпретировать полученную эконометрическую модель, владения навыками построения эконометрической модели
ПК-10 (профессиональные компетенции)	способность использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии в результате владения навыками построения эконометрических моделей с использованием программных продуктов
ПК-14 (профессиональные компетенции)	способность преподавать экономические дисциплины в образовательных учреждениях различного уровня, используя существующие программы и учебно-методические материалы благодаря знаниям, умениям и владениям по дисциплине ?Эконометрика?
ПК-15 (профессиональные компетенции)	способность принять участие в совершенствовании и разработке учебно-методического обеспечения экономических дисциплин на основе знаний, умений и владений по дисциплине ?Эконометрика?
ПК-3 (профессиональные компетенции)	способность выполнять необходимые для составления экономиче-ских разделов планов расчеты, обосновывать их и представлять результаты работы в соответствии с принятыми в организации стандартами благодаря владению навыками решения экономических задач с использованием эконометрических моделей
ПК-4 (профессиональные компетенции)	способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения поставленных экономических задач благодаря владению навыками построения эконометрических моделей
ПК-5 (профессиональные компетенции)	способность выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализиро-вать результаты расчетов и обосновать полученные выводы в результате умения применять программные продукты для построения эконометрических моделей

Шифр компетенции	Расшифровка приобретаемой компетенции
ПК-6 (профессиональные компетенции)	способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты на основе знания этапов эконометрического анализа, умения выполнять спецификацию модели и владения методом наименьших квадратов
ПК-9 (профессиональные компетенции)	способность, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные, проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет на основе знания типов эконометрических моделей и типов данных, умения представлять экономическую задачу в конкретной параметрической форме

В результате освоения дисциплины студент:

1. должен знать:

основные задачи и цели эконометрики;
этапы эконометрического моделирования;
модели регрессии, модели временных рядов, системы одновременных уравнений и типы данных, применяемых в эконометрическом моделировании;
методы получения оценок параметров эконометрических моделей;
область применимости основных эконометрических моделей и их ограничения.

2. должен уметь:

представлять экономическую задачу в конкретной параметрической форме;
получать оценки параметров эконометрической модели и проверять их качество;
проводить отбор факторов с целью улучшения спецификации модели;
проводить отбор адекватной модели из возможных вариантов;
экономически интерпретировать полученную эконометрическую модель.

3. должен владеть:

навыками построения согласованной с экономической теорией эконометрической модели;
приемами отбора факторов в эконометрическую модель;
методом наименьших квадратов и его обобщениями для оценивания параметров эконометрических моделей;
приемами преобразования данных в случае нарушения предпосылок метода наименьших квадратов;
навыками решения экономических задач с использованием эконометрических моделей;
навыками применения программных продуктов для построения эконометрических моделей.

к практическому применению полученных знаний и навыков в изучении взаимосвязей между экономическими переменными, построении эконометрических моделей для прогнозирования и принятия решений.

4. Структура и содержание дисциплины/ модуля

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6 зачетных(ые) единиц(ы) 216 часа(ов).

Форма промежуточного контроля дисциплины отсутствует во 2 семестре; экзамен в 3 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. Эконометрика как научная дисциплина	6	1	0	0	0	тестирование
2.	Тема 2. Основные понятия теории вероятностей и статистики, применяемые в эконометрике	6	1	0	0	0	тестирование
3.	Тема 3. Линейная модель парной регрессии и методы ее оценивания	6	2	1	0	0	контрольная работа тестирование
4.	Тема 4. Экономическая и статистическая интер-претация модели парной регрессии	6	2,3	1	0	0	контрольная работа тестирование
5.	Тема 5. Линейная модель множественной ре-грессии и оценка ее параметров	7	3	1	1	0	тестирование
6.	Тема 6. Оценка качества модели множественной регрессии	7	4	1	1	0	контрольная работа тестирование
7.	Тема 7. Мультиколлинеарность	7	4	0	2	0	тестирование
8.	Тема 8. Гетероскедастичность	7	5	0	1	0	контрольная работа тестирование

N	Раздел Дисциплины/ Модуля	Семестр	Неделя семестра	Виды и часы аудиторной работы, их трудоемкость (в часах)			Текущие формы контроля
				Лекции	Практические занятия	Лабораторные работы	
9.	Тема 9. Автокорреляция	7	5	0	1	0	контрольная работа тестирование
10.	Тема 10. Фиктивные переменные	7	6	0	0	0	тестирование
11.	Тема 11. Нелинейные регрессии и их линеаризация	7	6	0	0	0	тестирование
12.	Тема 12. Модели с дискретной зависимой переменной	7	7,7	0	0	0	тестирование
13.	Тема 13. Модели панельных данных	7	8	0	0	0	тестирование
14.	Тема 14. Ошибки спецификации	7	9	0	0	0	тестирование
15.	Тема 15. Модели одномерных временных рядов	7	10	1	1	0	контрольная работа тестирование
16.	Тема 16. Адаптивные модели временных рядов	7	11	0	0	0	тестирование
17.	Тема 17. Модели стационарных и нестационарных временных рядов	7	12	1	0	0	тестирование
18.	Тема 18. Модели с лаговыми переменными	7	13	0	1	0	контрольная работа
19.	Тема 19. Понятие о системах эконометрических уравнений	7	14	1	1	0	тестирование
20.	Тема 20. Методы оценки параметров систем одновременных уравнений	7	15	1	1	0	контрольная работа
	Тема . Итоговая форма контроля	3		0	0	0	экзамен
	Итого			8	10	0	

4.2 Содержание дисциплины

Тема 1. Эконометрика как научная дисциплина

Тема 2. Основные понятия теории вероятностей и статистики, применяемые в эконометрике

Тема 3. Линейная модель парной регрессии и методы ее оценивания

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Спецификация модели парной регрессии. Оценки параметров линейной регрессии. Метод максимального правдоподобия. Метод наименьших квадратов (МНК). Предпосылки МНК и свойства оценок МНК. Прогнозирование на основе линейного уравнения регрессии. Точечные и интервальные прогнозы.

Тема 4. Экономическая и статистическая интер-претация модели парной регрессии

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Экономическая интерпретация параметров модели. Коэффициенты корреляции и детерминации в линейной парной модели. Проверка адекватности модели линейной парной регрессии.

Тема 5. Линейная модель множественной ре-грессии и оценка ее параметров

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Общая модель множественной регрессии. Линейная модель множественной регрессии. Эмпирическая форма записи. Оценка параметров модели с по-мощью МНК.

практическое занятие (1 часа(ов)):

Линейная модель множествен-ной регрессии. Эмпирическая форма записи. Оценка параметров модели с помощью МНК: скалярный способ, матричный способ, запись уравнения в стандартизованном масштабе.

Тема 6. Оценка качества модели множественной регрессии

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Показатели качества множественной регрессии: индекс множественной корреляции и коэффициент детерминации. Скорректированный коэффициент детерминации. Оценка значимости уравнения в целом и каждого параметра в отдельности. Сравнение двух регрессий при включении и при исключении отдельных наборов переменных. Частные F-критерии.

практическое занятие (1 часа(ов)):

Скорректированный коэффициент детерминации. Оценка значимости уравнения в целом и каждого параметра в отдельности.

Тема 7. Мультиколлинеарность

практическое занятие (2 часа(ов)):

Обнаружение и устранение мультиколлинеарности. Анализ матрицы линейных коэффициентов парной корреляции, расчет определителя матрицы межфакторных корреляций.

Тема 8. Гетероскедастичность

практическое занятие (1 часа(ов)):

Тестирование остатков на гетероскедастичность: тест ранговой корреляции Спирмена, тест Голдфелда-Квандта. Применение взвешенного МНК.

Тема 9. Автокорреляция

практическое занятие (1 часа(ов)):

Тестирование остатков на автокорреляцию: тест Дарбина-Уотсона, метод рядов.

Тема 10. Фиктивные переменные

Тема 11. Нелинейные регрессии и их линеаризация

Тема 12. Модели с дискретной зависимой переменной

Тема 13. Модели панельных данных

Тема 14. Ошибки спецификации

Тема 15. Модели одномерных временных рядов

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Понятие временного ряда и его основные компоненты. Сглаживание временных рядов. Подходы к построению трендовых и тренд-сезонных моделей временных рядов. Прогнозирование на основе трендовой и тренд-сезонной моделей временных рядов.

практическое занятие (1 часа(ов)):

Построение трендовых и тренд-сезонных моделей временных рядов. Прогнозирование на основе трендовой и тренд-сезонной моделей временных рядов.

Тема 16. Адаптивные модели временных рядов

Тема 17. Модели стационарных и нестационарных временных рядов

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Модели стационарных и нестационарных временных рядов. Модель авторегрессии-скользящего среднего (модель ARMA). Авторегрессионная модель проинтегрированного скользящего среднего (модель ARIMA).

Тема 18. Модели с лаговыми переменными

практическое занятие (1 часа(ов)):

Оценивание параметров модели с распределенным лагом методом Койка и методом Алмон.

Тема 19. Понятие о системах эконометрических уравнений

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Система линейных одновременных уравнений. Системы независимых уравнений и системы взаимозависимых уравнений. Приведенная и структурная формы модели. Эндогенные, экзогенные и предопределенные переменные. Идентификация систем одновременных уравнений.

практическое занятие (1 часа(ов)):

Типы переменных и типы систем уравнений. Проверка системы на идентификацию.

Тема 20. Методы оценки параметров систем одновременных уравнений

лекционное занятие (1 часа(ов)):

Косвенный, двухшаговый и трехшаговый МНК. Применение систем уравнений для построения макроэкономических моделей и моделей спроса и предложения.

практическое занятие (1 часа(ов)):

Применение косвенного и двухшагового МНК для оценивания параметров систем одновременных уравнений

4.3 Структура и содержание самостоятельной работы дисциплины (модуля)

№	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
1.	Тема 1. Эконометрика как научная дисциплина	6	1	подготовка к тестированию	4	тестирование
2.	Тема 2. Основные понятия теории вероятностей и статистики, применяемые в эконометрике	6	1	подготовка к тестированию	10	тестирование
3.	Тема 3. Линейная модель парной регрессии и методы ее оценивания	6	2	подготовка к контрольной работе	5	контрольная работа
				подготовка к тестированию	4	тестирование
4.	Тема 4. Экономическая и статистическая интер-претация модели парной регрессии	6	2,3	подготовка к контрольной работе	5	контрольная работа
				подготовка к тестированию	5	тестирование

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
5.	Тема 5. Линейная модель множественной регрессии и оценка ее параметров	7	3	подготовка к тестированию	9	тестирование
6.	Тема 6. Оценка качества модели множественной регрессии	7	4	подготовка к контрольной работе	5	контрольная работа
				подготовка к тестированию	4	тестирование
7.	Тема 7. Мультиколлинеарность	7	4	подготовка к тестированию	10	тестирование
8.	Тема 8. Гетероскедастичность	7	5	подготовка к контрольной работе	5	контрольная работа
				подготовка к тестированию	5	тестирование
9.	Тема 9. Автокорреляция	7	5	подготовка к контрольной работе	5	контрольная работа
				подготовка к тестированию	5	тестирование
10.	Тема 10. Фиктивные переменные	7	6	подготовка к тестированию	10	тестирование
11.	Тема 11. Нелинейные регрессии и их линеаризация	7	6	подготовка к тестированию	10	тестирование
12.	Тема 12. Модели с дискретной зависимой переменной	7	7,7	подготовка к тестированию	10	тестирование
13.	Тема 13. Модели панельных данных	7	8	подготовка к тестированию	10	тестирование
14.	Тема 14. Ошибки спецификации	7	9	подготовка к тестированию	10	тестирование
15.	Тема 15. Модели одномерных временных рядов	7	10	подготовка к контрольной работе	5	контрольная работа
				подготовка к тестированию	4	тестирование
16.	Тема 16. Адаптивные модели временных рядов	7	11	подготовка к тестированию	10	тестирование
17.	Тема 17. Модели стационарных и нестационарных временных рядов	7	12	подготовка к тестированию	10	тестирование
18.	Тема 18. Модели с лаговыми переменными	7	13	подготовка к контрольной работе	10	контрольная работа

N	Раздел Дисциплины	Семестр	Неделя семестра	Виды самостоятельной работы студентов	Трудоемкость (в часах)	Формы контроля самостоятельной работы
19.	Тема 19. Понятие о системах эконометрических уравнений	7	14	подготовка к тестированию	9	тестирование
20.	Тема 20. Методы оценки параметров систем одновременных уравнений	7	15	подготовка к контрольной работе	10	контрольная работа
	Итого				189	

5. Образовательные технологии, включая интерактивные формы обучения

Освоение дисциплины "Эконометрика" предполагает использование как традиционных (лекции, практические занятия с использованием методических материалов), так и инновационных образовательных технологий с использованием в учебном процессе активных и интерактивных форм проведения занятий: тестирование с использованием программного продукта My Test, решение задач с использованием офисных приложений и специальных программных продуктов, организация самостоятельной работы на базе ЭОР в среде Moodle.

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

Тема 1. Эконометрика как научная дисциплина

тестирование , примерные вопросы:

Под идентификацией модели понимается: Под верификацией модели понимается: Выбор списка переменных модели и типа взаимосвязи между ними выполняются на этапе: По отношению к выбранной спецификации модели все экономические переменные объекта подразделяются на два типа: Экономические переменные, значения которых определяются вне данной модели, называются: Экономические переменные, значения которых определяются внутри данной модели, называются: Переменные, датированные предыдущими моментами времени и находящиеся в уравнении с текущими переменными, называются... К классу предопределенных переменных не относятся: Термин эконометрика был введен:

Тема 2. Основные понятия теории вероятностей и статистики, применяемые в эконометрике

тестирование , примерные вопросы:

Статистическими называют выводы, полученные путем: Случайная величина - это: Уровнем значимости называется: В экономике чаще всего большинство случайных величин задается в виде: Законы распределения случайной величины необходимы для: Альтернативной называется гипотеза: Стандартизированное нормальное распределение имеет параметры: Какими параметрами определяется распределение Фишера? Примером дискретной случайной величины является: При увеличении уровня доверительной вероятности ширина доверительного интервала:

Тема 3. Линейная модель парной регрессии и методы ее оценивания

контрольная работа , примерные вопросы:

Спецификация линейной модели парной регрессии Расчет параметров линейной модели парной регрессии

тестирование , примерные вопросы:

Требованием к уравнениям регрессии, параметры которых можно найти при помощи МНК является: Предпосылкой метода наименьших квадратов является то, что остатки: Поле корреляции применяется для: В линейном уравнении парной регрессии коэффициентом регрессии является значение: Система нормальных уравнений метода наименьших квадратов необходима для получения выборочных оценок: Свойствами оценок МНК являются: В нелинейной модели парной регрессии функция $f(x)$ является: Предпосылки метода наименьших квадратов исследуют поведение: Величина параметра (a) в уравнении парной линейной регрессии характеризует значение: Если предпосылки метода наименьших квадратов нарушены, то:

Тема 4. Экономическая и статистическая интер-претация модели парной регрессии

контрольная работа , примерные вопросы:

Экономическая интерпретация параметров регрессии Расчет обобщающего коэффициента эластичности Проверка статистической значимости линейной модели парной регрессии в целом Проверка статистической значимости оценок параметров линейной модели парной регрессии Расчет доверительного интервала для коэффициента регрессии тестирование , примерные вопросы:

Требованием к уравнениям регрессии, параметры которых можно найти при помощи МНК является: Если оценка параметра эффективна, то это означает: Если оценка параметра состоятельна, то это означает: Если оценка параметра является несмещенной, то это означает: При выборе спецификации модели парная регрессия используется в случае, когда: По теореме Гаусса-Маркова оценки коэффициентов регрессии, построенной обычным методом наименьших квадратов, среди всех линейных оценок будут являться: Для уравнения значение коэффициента корреляции составило 1. Следовательно . . . Разность фактического и теоретического значений результирующей переменной регрессионной модели называется? Оценка значимости уравнения в целом осуществляется по критерию: При хорошем качестве модели допустимым значением средней ошибки аппроксимации является ?

Тема 5. Линейная модель множественной регрессии и оценка ее параметров

тестирование , примерные вопросы:

Требованием к факторам в уравнениях множественной регрессии являются: требованием метода наименьших квадратов к остаткам регрессии является: В линейном уравнении множественной регрессии коэффициентом регрессии является значение: Система нормальных уравнений метода наименьших квадратов необходима для получения выборочных оценок: Свойствами оценок МНК являются: В нелинейной модели множественной регрессии функция $f(x)$ является: Коэффициенты регрессии в линейной модели множественной регрессии измеряют: Величина параметра (a) в линейной модели множественной регрессии характеризует значение:

Тема 6. Оценка качества модели множественной регрессии

контрольная работа , примерные вопросы:

Расчет частных коэффициентов эластичности Проверка статистической значимости линейной модели множественной регрессии в целом Проверка статистической значимости оценок параметров линейной модели множественной регрессии Расчет частных коэффициентов корреляции Расчет стандартизованных коэффициентов регрессии Расчет доверительного интервала для коэффициента регрессии

тестирование , примерные вопросы:

Нелинейным уравнением множественной регрессии является: Установите соответствие между видом уравнения множественной регрессии и процессом его построения: В стандартизованном уравнении свободный член: При проверке независимых переменных на отсутствие мультиколлинеарности должно выполняться требование: Определите какой из факторов оказывает более сильное влияние на зависимую переменную: При моделировании уравнения множественной регрессии проверку тесноты связи между независимыми переменными (объясняющими переменными, регрессорами, факторами) модели осуществляют на основе: Если расчетное значение критерия Фишера меньше табличного значения, то гипотеза о статистической незначимости уравнения: Метод наименьших квадратов не применим для:

Тема 7. Мультиколлинеарность

тестирование , примерные вопросы:

Оценки параметров регрессии ненадежны, имеют большие стандартные ошибки и меняются с изменением объема наблюдений, не только по величине, но и по знаку. Это характерно для линейной модели множественной регрессии при: Факторы эконометрической модели являются коллинеарными, если коэффициент: Для выявления коллинеарных и мультиколлинеарных существенных факторов применяется: Из пары коллинеарных факторов в эконометрическую модель включается тот фактор... Мультиколлинеарность факторов эконометрической модели подразумевает: Отбор факторов в модель множественной регрессии при помощи метода исключения основан на сравнении значений: Взаимодействие факторов эконометрической модели означает, что: Основным требованием к факторам, включаемым в модель множественной регрессии является: Факторы коллинеарны, если определитель матрицы межфакторных корреляций:

Тема 8. Гетероскедастичность

контрольная работа , примерные вопросы:

Тестирование остатков модели на гетероскедастичность методом Голдфелда-Квандта
Тестирование остатков модели на гетероскедастичность методом Спирмена
Тестирование остатков модели на гетероскедастичность путем построения полулогарифмической регрессии
тестирование , примерные вопросы:

На основании преобразования переменных при помощи обобщенного метода наименьших квадратов получаем новое уравнение регрессии, которое представляет собой: Обобщенный метод наименьших квадратов используется для моделей с _____ остатками. После применения метода взвешенных наименьших квадратов удастся избежать _____ остатков: Гетероскедастичность ошибок в регрессионных моделях означает, что они имеют: В хорошо подобранной модели остатки должны: Для выявления гетероскедастичности применяется: Тест Голдфелда-Квандта предусматривает построение следующего количества выборочных уравнений регрессии: Метод оценки параметров моделей с гетероскедастичными остатками называется _____ методом наименьших квадратов: Метод взвешенных наименьших квадратов отличается от обычного МНК тем, что при применении МВНК: Обобщенный метод наименьших квадратов подразумевает: Что преобразуется при применении метода взвешенных наименьших квадратов:

Тема 9. Автокорреляция

контрольная работа , примерные вопросы:

Тестирование остатков на автокорреляцию методом Дарбина-Уотсона
Тестирование остатков на автокорреляцию методом рядов

тестирование , примерные вопросы:

Для выявления автокорреляции применяется: Авторегрессионное преобразование рекомендуется применять в случае: Последовательность коэффициентов автокорреляции в зависимости от величины лага называется: Коэффициент, измеряющий взаимосвязь двух соседних остатков называется: Последствия автокорреляции проявляются в: Критерий Дарбина-Уотсона не применим к: Положительная автокорреляция наблюдается, когда: Отсутствие автокорреляции проявляется в: Автокорреляция остатков - это:

Тема 10. Фиктивные переменные

тестирование , примерные вопросы:

Для учета действия на результат признаков качественного характера в уравнение регрессии включаются... Строится модель зависимости спроса от ряда факторов. Фиктивной переменной в данном уравнении множественной регрессии не являются: Проводится исследование зависимости выработки работника предприятия от ряда факторов. Примером фиктивной переменной в данной модели будет являться: Фиктивные переменные включаются в уравнение множественной регрессии для учета действия на результат признаков: Укажите уравнения регрессии, в которых фиктивная переменная D используется только в аддитивной форме: Укажите уравнения регрессии, в которых фиктивная переменная D используется только в мультипликативной форме: Для учета действия на зависимую переменную факторов качественного характера (так называемых фиктивных переменных) последним могут присваиваться: Для проверки на целесообразность включения фиктивной переменной используется тест... Значение фиктивной переменной, равное 0, называется ... Влияние качественного признака на изменение зависимой переменной в модели регрессии подтверждается...

Тема 11. Нелинейные регрессии и их линеаризация

тестирование , примерные вопросы:

Нелинейным уравнением множественной регрессии является ? Нелинейная регрессия представляет собой ? Уравнением нелинейной регрессии, отражающей полиномиальную зависимость y от x , является ? Нелинейным уравнением парной регрессии является ? Нелинейная регрессионная модель отражает ? Уравнением нелинейной регрессии, являющейся нелинейной по параметрам является ? Уравнением нелинейной регрессии, линейной по параметрам является ? Переменная x является нелинейной в уравнении ? Не является полиномом регрессионная модель ? При линеаризации нелинейных регрессионных моделей как один из видов преобразований используется логарифмирование уравнения. Указанным способом не может быть линеаризовано уравнение ? При линеаризации нелинейных регрессионных моделей как один из видов преобразований используется замена переменных. Указанным способом не может быть линеаризовано уравнение ? При линеаризации нелинейных регрессионных моделей как один из видов преобразований используется логарифмирование уравнения. Указанным способом может быть линеаризовано уравнение ? При линеаризации нелинейных регрессионных моделей как один из видов преобразований используется замена переменных. Указанным способом может быть линеаризовано уравнение ?

Тема 12. Модели с дискретной зависимой переменной

тестирование , примерные вопросы:

Зависимую переменную называю дискретной, если: Значениями дискретной зависимой переменной являются: В пробит-модели использована функция: В логит-модели использована функция: Для оценивания параметров в моделях с дискретной зависимой переменной применяют метод: Уравнение правдоподобия представляет собой: Коэффициент детерминации Макфаддена измеряет: Для проверки гипотезы о значимости коэффициентов в моделях бинарного выбора применяют: Статистика Вальда показывает: Случайные полезности являются линейными функциями от: Дискретная модель с упорядоченными альтернативами основана на предположении, что:

Тема 13. Модели панельных данных

тестирование , примерные вопросы:

Панельными называется множество данных: Сбалансированной панелью называют: Ротационной панелью называют: Модель с фиксированными эффектами-это: В модели с фиксированными эффектами моделируется: В модели со случайными эффектами моделируется: Для оценивания параметров модели со случайными эффектами применяется: Проверка на наличие случайных эффектов проводится с помощью: Тест множителей Лагранжа состоит в: Тест Хаусмана состоит в:

Тема 14. Ошибки спецификации

тестирование , примерные вопросы:

Спецификация модели - это: Признаком хорошей модели является: Чтобы обнаружить ошибку спецификации необходимо: Для характеристики прогнозных качеств используют: К ошибкам спецификации относятся: Аналитический метод выбора функции основан на: Экспериментальный метод выбора функции основан на: Последствием отбрасывания значимой переменной является: Последствием добавления незначимой переменной является: Замещающие переменные применяются для: Условием применения замещающей переменной является взаимосвязь с недостающей переменной.

Тема 15. Модели одномерных временных рядов

контрольная работа , примерные вопросы:

Расчет трендовой компоненты Расчет сезонной компоненты Построение аддитивной модели временного ряда Построение мультипликативной модели временного ряда

тестирование , примерные вопросы:

Каждый уровень временного ряда может содержать Аддитивная модель временного ряда имеет вид Коррелограммой называется Мультипликативная модель имеет вид Наиболее высокий коэффициент автокорреляции уровней временного ряда первого порядка говорит о том, что исследуемый ряд Если ни один из коэффициентов автокорреляции уровней временного ряда не является значимым, это говорит о том, что исследуемый ряд Автокорреляция уровней ряда-это Прогнозирование по мультипликативной модели временного ряда сводится к применению выражения Отличительной особенностью аддитивных моделей следует считать Отличительной особенностью мультипликативных моделей следует считать Непосредственно измерив характеристики объекта через определенные промежутки времени или усреднив данные за некоторый период времени, формируют последовательность

Тема 16. Адаптивные модели временных рядов

тестирование , примерные вопросы:

Модель адаптивных ожиданий содержит: Механизм формирования ожиданий в модели адаптивных ожиданий заключается в: Ожидаемое значение факторной переменной определяется как: Краткосрочная функция модели адаптивных ожиданий представляет собой: Об устойчивости существующих тенденций свидетельствует: Модель неполной корректировки содержит: Краткосрочная функция модели неполной корректировки является:

Тема 17. Модели стационарных и нестационарных временных рядов

тестирование , примерные вопросы:

Динамическая информация учитывается в неявном виде в моделях: Для оценивания моделей с распределенным лагом применяется метод Графическое изображение коэффициентов автокорреляции, начиная с первого, это Для оценивания авторегрессионных моделей применяется метод Процесс "белый шум" является _____ временным рядом Модели авторегрессии интегрированного скользящего среднего (АРИСС-модели) имеют вид Скользящим средним порядка q называется последовательность вида Авторегрессионная часть модели состоит из разностного уравнения с правой частью Скользящим средним порядка q называется последовательность вида

Тема 18. Модели с лаговыми переменными

контрольная работа , примерные вопросы:

Расчет долгосрочного мультипликатора модели Расчет относительных коэффициентов модели Расчет среднего лага

Тема 19. Понятие о системах эконометрических уравнений

тестирование , примерные вопросы:

Оценки параметров идентифицируемой системы эконометрических уравнений... Если хотя бы одно уравнение структурной системы сверхидентифицируемо, тогда система в целом... Если хотя бы одно уравнение системы является неидентифицируемым, то... Система уравнений считается идентифицируемой, если... Параметры системы независимых уравнений оценивают... Для оценки параметров системы взаимосвязанных уравнений применяют... Экзогенными переменными являются... Если структурные коэффициенты системы одновременных уравнений не могут быть оценены через коэффициенты приведенной формы модели, данная система уравнений называется... Приведенная форма модели является результатом преобразования... Имеется макроэкономическая модель: Реальный экономический процесс описывают с помощью системы одновременных уравнений в _____ форме

Тема 20. Методы оценки параметров систем одновременных уравнений

контрольная работа , примерные вопросы:

Проверка системы одновременных уравнений на идентификацию Применение косвенного МНК для оценивания структурных коэффициентов модели Применение двухшагового МНК для оценивания структурных коэффициентов модели

Тема . Итоговая форма контроля

Примерные вопросы к экзамену:

Вопросы к экзамену (зачету)

Тестовые задания к экзамену находятся в учебно-методическом комплексе на кафедре, электронный вариант - на сайте института.

7.1. Основная литература:

1. Балдин К.В., Быстров О. Ф., Соколов М. М. Эконометрика: учебное пособие. -М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2012. - 254 с. (<http://www.knigafund.ru/books>)
2. Гладилин А.В., Громов Е.И., Герасимов А.Н. Эконометрика: Учебное пособие. - М. : Кнорус, 2011. - 297 с. (<http://www.knigafund.ru/books>)
3. Доугерти К. Введение в эконометрику: Учебник. 2 - е изд. / Пер. с англ. - М.: ИНФРА - М, 2009, 432 с.
4. Елисеева И.И. Эконометрика: Учебник. - М.: Финансы и статистика, 2007.
5. Кремер Н.Ш., Путко Б.А. Эконометрика: Учебник для вузов / Под ред. проф. Н.Ш. Кремера. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2008. - 311 с.
6. Новиков А. И. Эконометрика: учебное пособие. - М.: Дашков и К, 2013. -224 с. (<http://www.knigafund.ru/books>)
7. Практикум по эконометрике: Учебное пособие / Под ред. И.И. Елисеевой. - М.: Финансы и статистика, 2007. - 176 с.
8. Тихомиров Н. Методы эконометрики и многомерного статистического анализа. -М.: Экономика, 2011 г. - 647 с.
9. Эконометрика: Учебник / Под редакцией И. И. Елисеевой. - М.: Про-спект, 2010. - 288 с.

7.2. Дополнительная литература:

1. Айвазян С. А. Основы эконометрики. Т.2. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2008. - 432 с.
2. Бородич С.А. Эконометрика: Учебное пособие. - Мн.: Новое знание, 2006. - 408 с.
3. Валентинов В.А. Эконометрика: Учебник . - М.: Дашков и К, 2008.-434 с.
4. Вербик Марно. Путеводитель по современной эконометрике. Пер. с англ. ? М.: Научная книга, 2008. - 616 с.
5. Магнус Я.Р., Катышев П.К, Пересецкий А.А. Эконометрика. Начальный курс. Учебник - М.: Дело, 2007.- 248 с.

6. Плохотников К. Е. Основы эконометрики в пакете STATISTICA: Учебное пособие. - М.: Вузовский учебник, 2010. - 298 с.
7. Сборник задач по эконометрике: Уч. пособие для студентов экономических вузов. Сост. Е.Ю. Дорохина, Л.Ф. Преснякова, Н.П. Тихомиров. - М.: Экзамен, 2003.
8. Тадеуш Куфель. Эконометрика. Решение задач с применением пакета программ GRETL: Учебное пособие. - М.: Горячая линия - Телеком, 2007 г. - 200 с.
9. Тихомиров Н. П., Дорохина Е.Ю. Эконометрика: Учебник. Изд-во "Экзамен", 2007.- 512 с.
10. Эконометрика: Учебник / Под ред. В. С. Мхитаряна. - М.: Проспект, 2008. - 384 с.
11. Эконометрика: Учебник / Под ред. В. Б. Уткина. - М.: Дашков и К, 2011. - 562 с.
12. Jeffrey M. Wooldridge, Introductory Econometrics: A Modern Approach, Other, Mixed media product, 2008.
13. William H. Greene, Econometric Analysis, - 5th ed. Upper Saddle River : Prentice Hall, 2003.

7.3. Интернет-ресурсы:

Канторович Г. Г. Лекции: Анализ временных рядов, ?Экономический журнал ВШЭ? Том. 6 (2002), ♦1,2,3,4 и Том. 7 (2003), ♦1 -
http://library.hse.ru/e-resources/HSE_economic_journal/articles/06_01_06.pdf
?Квантиль?. Международный эконометрический журнал на русском языке - <http://quantile.ru>
Орлов А. И. Эконометрика: учебник. ? М.: Экзамен. - 2004 г. - 412 с. -
<http://institutions.com/general/1647-ekonometrika-orlov.html>
официальный сайт федеральной службы по статистике Российской Федерации - <http://www.gks.ru>
официальный сайт Центрального банка России - <http://www.cbr.ru>
Ратникова Т. А. Введение в эконометрический анализ панельных данных, ?Экономический журнал ВШЭ?, ♦2, 2006 -
http://library.hse.ru/e-resources/HSE_economic_journal/articles/10_02_06.pdf
федеральный образовательный портал ?Экономика. Социология. Менеджмент? -
<http://ecsocman.hse.ru/>
электронный учебник по статистике, созданный компанией StatSoft, разработчиком популярного пакета STATISTICA - <http://www.statsoft.ru/home/textbook/default.htm>

8. Материально-техническое обеспечение дисциплины/модуля согласно утвержденному учебному плану

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.

Учебно-методическая литература для данной дисциплины имеется в наличии в электронно-библиотечной системе "КнигаФонд", доступ к которой предоставлен студентам. Электронно-библиотечная система "КнигаФонд" реализует легальное хранение, распространение и защиту цифрового контента учебно-методической литературы для вузов с условием обязательного соблюдения авторских и смежных прав. КнигаФонд обеспечивает широкий законный доступ к необходимым для образовательного процесса изданиям с использованием инновационных технологий и соответствует всем требованиям новых ФГОС ВПО.

Программа составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВПО и учебным планом по направлению 080100.62 "Экономика" и профилю подготовки Бухгалтерский учет, анализ и аудит .

Автор(ы):

Исмагилов И.И. _____

Кадочникова Е.И. _____

Кундакчян Р.М. _____

"__" _____ 201__ г.

Рецензент(ы):

Костромин А.В. _____

"__" _____ 201__ г.