

УТВЕРЖДАЮ
 Первый проректор, проректор по
 учебной работе
 _____ А.Е. Рудин

«30» июня 2020 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.01

Эконометрика

(Индекс дисциплины)

(Наименование дисциплины)

Кафедра: **29** Менеджмента

Код

Наименование кафедры

Направление подготовки:

38.04.01 «Экономика»

Профиль подготовки:

Управленческий учет и внутренний аудит

Уровень образования: **Магистратура**

План учебного процесса

Составляющие учебного процесса		Очное обучение	Очно-заочное обучение	Заочное обучение
Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся (часы)	Всего	108		108
	Аудиторные занятия	51		16
	Лекции	17		4
	Лабораторные занятия			
	Практические занятия	34		12
	Самостоятельная работа	57		88
	Промежуточная аттестация			4
Формы контроля по семестрам (номер семестра)	Экзамен			
	Зачет	1		2
	Контрольная работа			2
	Курсовой проект (работа)			
Общая трудоемкость дисциплины (зачетные единицы)		3		3

Форма обучения:	Распределение зачетных единиц трудоемкости по семестрам											
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
Очная	3	.										
Очно-заочная												
Заочная	0,5	3										

Рабочая программа составлена в соответствии с федеральным государственным
Образовательным стандартом высшего образования
по соответствующему направлению подготовки 38.04.01 Экономика

и на основании учебного плана № 2/1/615, 2/3/616

1. ВВЕДЕНИЕ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1. Место преподаваемой дисциплины в структуре образовательной программы

Блок 1: Базовая Обязательная Дополнительно является факультативом
Вариативная По выбору

1.2. Цель дисциплины

Сформировать компетенции обучающегося в области построения и применения эконометрических моделей для анализа состояния и оценки перспектив развития экономических и социальных систем в условиях взаимосвязей между их внутренними и внешними факторами.

1.3. Задачи дисциплины

- Расширить и углубить теоретические знания о качественных особенностях экономических и социальных системах, количественных взаимосвязях и закономерностях их развития.
- Овладеть методологией и методикой построения, анализа и применения эконометрических моделей, как для анализа состояния, так и для оценки перспектив развития указанных систем.
- Сформировать навыки проведения сложных компьютерных расчетов с использованием эконометрических моделей.
- Подготовить специалистов, обладающих исследовательским потенциалом.

1.4. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код компетенции	Формулировка компетенции	Этап формирования
ОК- 1	Способность к абстрактному мышлению, анализу, синтезу	Первый
Планируемые результаты обучения Знать: 1) закономерности функционирования современной экономики на макро- и микроуровне; современные методы эконометрического анализа Уметь: 1) применять современный математический инструментарий для решения содержательных экономических задач; использовать современное программное обеспечение для решения экономико - статистических и эконометрических задач Владеть: 1) навыками микроэкономического и макроэкономического моделирования с применением современного инструментария		
ОПК- 1	Готовность к коммуникации в устной и письменной формах на русском и иностранном языках для решения задач профессиональной деятельности	Первый
Планируемые результаты обучения Знать: 1) основные результаты новейших исследований, опубликованные в ведущих профессиональных журналах по проблемам эконометрики; современные программные продукты, необходимые для решения экономико-статистических задач Уметь: 1) формировать прогнозы развития конкретных и экономических процессов на макро - и микроуровне. Владеть: 1) Навыками проведения научных исследований в профессиональной сфере; навыками построения эконометрических моделей		

Код компетенции	Формулировка компетенции	Этап формирования
ПК- 9	Способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения экономических расчетов	Первый
<p>Планируемые результаты обучения</p> <p>Знать:</p> <p>1) основные методы сбора и обработки статистических данных; -</p> <p>Уметь:</p> <p>1) использовать основные методы сбора и обработки статистических данных</p> <p>Владеть:</p> <p>1) Навыками решения экономических задач с помощью методов эконометрики.</p>		

1.5. Дисциплины (практики) образовательной программы, в которых было начато формирование компетенций, указанных в п.1.4:

Философские проблемы науки и техники (ОК-1), Деловой иностранный язык (ОПК-1)
Макроэкономика (ПК-9)

2. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Учебный модуль 1. Возникновение и развитие эконометрики. Парная регрессия			
Тема 1. Возникновение и развитие эконометрики. Определение эконометрики. Области применения эконометрических моделей. Методологические вопросы построения эконометрической модели.	4		4
Тема 2. Парная регрессия и корреляция. Линейная модель парной регрессии и корреляции. Нелинейные модели парной регрессии и корреляции.	6		6
Текущий контроль 1 (реферат)	2		
Учебный модуль 2. Множественная регрессия. Фиктивные переменные. Системы эконометрических уравнений.			
Тема 3. Множественная линейная регрессия в скалярной и векторной форме. Метод наименьших квадратов (МНК) и предпосылки его применения. Следствия выполнения предпосылок Гаусса – Маркова. Изучение тесноты связи по множественной регрессии. Проверка значимости модели множественной регрессии и ее параметров. Множественная линейная регрессия с ограничениями на параметры.	8		8
Тема 4. Нелинейные модели множественной регрессии. Выбор наилучшей функции регрессии. Метод максимального правдоподобия. Прогнозирование по модели множественной регрессии. Мультиколлинеарность данных.	8		8
Тема 5. Гетероскедастичность данных. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК).	8		8
Тема 6. Фиктивные переменные. Особенности включения в модели регрессии неколичественных показателей. Спецификация моделей регрессии с фиктивными независимыми переменными. Модели регрессии с фиктивными переменными сдвига и наклона. Общий вид модели регрессии с фиктивными переменными. Исследование структурных изменений с помощью теста Чоу.	8		8
Тема 7. Системы эконометрических уравнений. Виды систем эконометрических уравнений и методы их оценивания. Системы одновременных уравнений. Уравнения, кажущиеся несвязанными.	8		8
Текущий контроль 2 (доклад)	2		
Учебный модуль 3. Моделирование изолированного динамического ряда. Модели регрессии по временным рядам. Модели с лаговыми переменными.			

Наименование и содержание учебных модулей, тем и форм контроля	Объем (часы)		
	очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Модели ARMA, ARIMA, ARCH, GARCH. Анализ панельных данных.			
Тема 8. Моделирование изолированного динамического ряда. Компоненты динамического ряда. Автокорреляция уровней динамического ряда и характеристика его структуры. Модели тенденции развития. Моделирование периодических колебаний.	8		8
Тема 9. Модели регрессии по временным рядам. Специфика изучения взаимосвязей по рядам динамики. Учет тенденции при построении модели регрессии. ОМНК при построении модели регрессии по временным рядам. Учет сезонности при построении модели регрессии.	8		8
Тема 10. Модели с лаговыми переменными. Общая характеристика. Модели с распределенными лагами. Модели авторегрессии. Авторегрессионные процессы и их моделирование (общая характеристика).	8		8
Тема 11. Модели ARMA, ARIMA, ARCH, GARCH. Стационарный ряд. Базовые модели временных рядов. Теорема декомпозиции Вольда. Частная автокорреляционная функция. Модель ARMA. Модель ARIMA. Коинтеграция. Модели ARCH и GARCH.	8		8
Тема 12. Анализ панельных данных. Панельные данные и их преимущества. Однонаправленные модели панельных данных. Качество подготовки. Выбор модели. Двухнаправленная модель панельных данных с фиксированными эффектами.	8		8
Текущий контроль 3 (доклад/контрольная работа)	2		14
Промежуточная аттестация по дисциплине зачет	12		4
ВСЕГО:	108		108

3. ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН

3.1. Лекции

Номера изучаемых тем	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
1	1	1			2	
2	1	1			2	0,5
3	1	2			2	0,5
4	1	1			2	
5	1	1			2	0,5
6	1	1			2	
7	1	1			2	0,5
8	1	2			2	0,5
9	1	2			2	0,5
10	1	2			2	0,5
11	1	1			2	
12	1	2			2	0,5
Всего:		17				4

3.2. Практические и семинарские занятия

Номера изучаемых тем	Наименование и форма занятий	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
2	Парная регрессия (расчетная работа)	1	2			2	1
3-4	Множественная регрессия (расчетная работа)	1	8			2	2
5	Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК) (семинар).	1	4			2	1
6	Фиктивные переменные	1	4			2	1

Номера изучаемых тем	Наименование и форма занятий	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
	(семинар)						
7	Системы эконометрических уравнений (расчетная работа)	1	4			2	2
8-11	Временные ряды (расчетная работа)	1	8			2	4
12	Анализ панельных данных.(семинар)	1	4			2	1
ВСЕГО:			34				12

3.3. Лабораторные занятия Не предусмотрено

4. КУРСОВОЕ ПРОЕКТИРОВАНИЕ

Не предусмотрено

5. ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Номера учебных модулей, по которым проводится контроль	Форма контроля знаний	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
		Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во	Номер семестра	Кол-во
1	Реферат	1	1				
2-3	Доклад	1	2				
1-3	Контрольная работа					2	1

6. САМОСТОЯТЕЛЬНАЯ РАБОТА ОБУЧАЮЩЕГОСЯ

Виды самостоятельной работы обучающегося	Очное обучение		Очно-заочное обучение		Заочное обучение	
	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)	Номер семестра	Объем (часы)
<i>Усвоение теоретического материала</i>	1	16			2	35
<i>Подготовка к практическим (семинарским) и лабораторным занятиям</i>	1	29			2	39
<i>Выполнение домашних заданий</i>					2	14
<i>Подготовка к зачетам</i>	1	12			2	4
ВСЕГО:			57			92

7. ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

7.1. Характеристика видов и используемых инновационных форм учебных занятий

Наименование видов учебных занятий	Используемые инновационные формы	Объем занятий в инновационных формах (часы)		
		очное обучение	очно-заочное обучение	заочное обучение
Лекции	проблемная лекция, разбор конкретных ситуаций, лекция-диалог,	8		2
Практические и семинарские занятия	дискуссия, презентация результатов практических заданий.	10		2
ВСЕГО:		18		4

7.2. Балльно-рейтинговая система оценивания успеваемости и достижений обучающихся Перечень и параметры оценивания видов деятельности обучающегося

№ п/п	Вид деятельности обучающегося	Весовой коэффициент значимости, %	Критерии (условия) начисления баллов
1.	Аудиторная активность: посещение лекций и практических (семинарских) занятий, выступление с докладом, рефератом	30	<ul style="list-style-type: none"> • 2 балла за каждое занятие (всего 25 занятий в семестре), максимум 50 баллов; • 10 баллов за реферат (в семестре 1 реферат), максимум 10 баллов; • 20 баллов за доклад на занятии (всего 2 доклада в семестре), максимум 40 баллов
2	Выполнение и защита практического задания	30	<ul style="list-style-type: none"> • Представление в срок и качество оформления – максимум 15 баллов; • Содержание (соответствие заданию, наличие всех требуемых элементов, наличие и значимость ошибок) – максимум 50 баллов; • Качество защиты (полнота ответов на вопросы, владение специальной терминологией, затраченное на ответы время) – максимум 35 баллов.
2.	Сдача зачета	40	<ul style="list-style-type: none"> • Ответ на теоретический вопрос (полнота, владение терминологией, затраченное время) – максимум 40 баллов; • Решение практической задачи – до 12 баллов за каждую (всего 5 задач), максимум 60 баллов.
Итого (%):		100	

Перевод балльной шкалы в традиционную систему оценивания

Баллы	Оценка по нормативной шкале	
86 - 100	5 (отлично)	Зачтено
75 – 85	4 (хорошо)	
61 – 74		
51 - 60		
40 – 50	3 (удовлетворительно)	Не зачтено
17 – 39	2 (неудовлетворительно)	
1 – 16		
0		

8. ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

8.1. Учебная литература

а) основная учебная литература

1. Кремер Н. Ш. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебник для студентов вузов/ Кремер Н. Ш., Путко Б. А.— Электрон. текстовые данные.— Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2017.— 328 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/71071.html>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю.

2. Ивченко Ю. С. Эконометрика [Электронный ресурс]: курс лекций/ Ивченко Ю. С.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Вузовское образование, 2018.— 121 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/73609.html>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю.

3. Балдин К. В. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебник/ К. В. Балдин [и др.].— Электрон. текстовые данные.— Москва: Дашков и К, 2017.— 562 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/85150.html>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю.

б) дополнительная учебная литература

1. Мотина В. Г. Эконометрика. Построение и анализ модели линейной регрессии. Ч. 1 [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие в 2-х частях/ Мотина В. Г.— Электрон. текстовые данные.— Симферополь: Университет экономики и управления, 2020.— 92 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/101406.html>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю.

2 Мотина В. Г. Эконометрика. Множественная линейная регрессия. Однофакторная нелинейная регрессия. Временные ряды. Ч. 2 [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие по направлениям подготовки «Экономика», «Бизнес-информатика» для бакалавров очной и заочной форм обучения в 2-х частях/ Мотина В. Г.— Электрон. текстовые данные.— Симферополь:

Университет экономики и управления, 2020.— 68 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/101405.html>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю.

3. Ивченко Ю. С. Эконометрика в MS EXCEL [Электронный ресурс]: лабораторный практикум/ Ивченко Ю. С.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2018.— 94 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/70785.html>.— ЭБС «IPRbooks», по паролю.

8.2. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

1. Лашкова И. А. Методические указания по выполнению контрольной и самостоятельной работы студентами магистратуры заочной формы обучения направления 38.04.01 – «Экономика» по дисциплине «Эконометрика» – СПб.: СПбГУПТД, 2019. – 42 с. (темы контрольных работ, вопросы к зачету, тестовые задания). Режим доступа http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=201943, по паролю.

2. Лашкова И. А. Методические указания по выполнению практических заданий, контрольной и самостоятельной работы студентами магистратуры всех форм обучения направления 38.04.01 – «Экономика» по дисциплине «Эконометрика» /И. А. Лашкова, Т. В. Сметанина – СПб.: СПбГУПТД, 2018. – 37 с. (темы практических и контрольных заданий по основным разделам дисциплины). Режим доступа http://publish.sutd.ru/tp_ext_inf_publish.php?id=2018348, по паролю.

3. Спицкий С. В. Эффективная аудиторная и самостоятельная работа обучающихся: методические указания / С. В. Спицкий. — СПб.: СПбГУПТД, 2015. – Режим доступа:http://publish.sutd.ru/tp_get_file.php?id=2015811, по паролю

4. Караулова И. Б. Организация самостоятельной работы обучающихся / И. Б. Караулова, Г. И. Мелешкова, Г. А. Новоселов. – СПб.: СПГУТД, 2014. – 26 с. – Режим доступ http://publish.sutd.ru/tp_get_file.php?id=2014550, по паролю

8.3. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", необходимых для освоения дисциплины

1. **образовательные ресурсы** (Информационная система «Единое окно доступа к образовательным ресурсам» [Электронный ресурс]. URL: <http://window.edu.ru/>).

2. **информационные ресурсы сети «Интернет»**, необходимые для освоения дисциплины(ЭБС IPRbooks [Электронный ресурс]. URL: <http://www.iprbookshop.ru> ; электронная библиотека учебных изданий СПбГУПТД [Электронный ресурс]. URL: [http:// www.publish.sutd.ru](http://www.publish.sutd.ru)).

3. **материалы Информационно-образовательной среды заочной формы обучения СПбГУПТД** [Электронный ресурс]. URL: http://sutd.ru/studentam/extramural_student

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

1. Windows 10,;

2. Office 2016, (Наименование продукта: Microsoft Office Standart 2016 Russian Open No Level Academic);

3. Windows 10 Pro (Наименование продукта: Microsoft Windows 10 Home Russian Open No Level Academic Legalization Get Genuine (GGK) + Microsoft Windows 10 Professional (Pro – профессиональная) Russian Upgrade Open No Level Academic)

4. Windows 10 Pro (Наименование продукта:Microsoft Windows 10 Home Russian Open No Level Academic Legalization Get Genuine (GGK) + Microsoft Windows 10 Professional (Pro – профессиональная) Russian Upgrade Open No Level Academic

5. Windows 10 Pro (Наименование продукта: Microsoft Windows 10 Home Russian Open No Level Academic Legalization Get Genuine (GGK) + Microsoft Windows 10 Professional (Pro – профессиональная) Russian Upgrade Open No Level Academic ;

6. OfficeStd 2016 RUS OLP NL Acdmc, сублицензионный

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

1... стандартно оборудованная аудитория,

2...компьютер.

8.6. Иные сведения и (или) материалы

Не предусмотрено

9. МЕТОДИЧЕСКИЕ УКАЗАНИЯ ДЛЯ ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ОСВОЕНИЮ ДИСЦИПЛИНЫ

Виды учебных занятий и самостоятельная работа обучающихся	Организация деятельности обучающегося
Лекции	<p>Лекции обеспечивают теоретическое изучение дисциплины. На лекциях излагается основное содержание курса, иллюстрируемое конкретными примерами, широко используется зарубежный и отечественный опыт по соответствующей тематике.</p> <p>Освоение лекционного материала обучающимся предполагает следующие виды работ:</p> <ul style="list-style-type: none"> • проработка рабочей программы в соответствии с целями и задачами, структурой и содержанием дисциплины; • конспект лекций: кратко, схематично, последовательно фиксировать основные положения, выводы и формулировки; помечать важные мысли, выделять ключевые слова, термины. • Проверка терминов, понятий: осуществлять с помощью энциклопедий, словарей, справочников с выписыванием толкований в тетрадь; • работа с теоретическим материалом (конспектирование источников): найти ответ на вопросы в рекомендуемой литературе. <p>Если самостоятельно не удастся разобраться в материале, необходимо сформулировать вопрос и задать преподавателю на консультации или на практическом занятии.</p>
Практические занятия	<p>На практических занятиях (семинарах) разъясняются теоретические положения курса, обучающиеся работают с конкретными ситуациями, овладевают навыками сбора, анализа и обработки информации для принятия самостоятельных решений, навыками подготовки информационных обзоров и аналитических отчетов по соответствующей тематике; навыками работы в малых группах; развивают организаторские способности по подготовке коллективных проектов.</p> <p>Подготовка к практическим занятиям предполагает следующие виды работ: работа с конспектом лекций;</p> <ul style="list-style-type: none"> • подготовка ответов к контрольным вопросам; • просмотр рекомендуемой литературы, работа с текстом (указать текст из источника и др.); • решение расчетно-графических заданий.
Лабораторные занятия	Не предусмотрены
Самостоятельная работа	<p>Данный вид работы предполагает расширение и закрепление знаний, умений и навыков, усвоенных на аудиторных занятиях путем самостоятельной проработки учебно-методических материалов по дисциплине и другим источникам информации; выполнения рефератов; подготовку к докладам; выполнение контрольной работы; а также подготовки к контрольным работам и зачету. Самостоятельная работа выполняется индивидуально, а также может проводиться под руководством (при участии) преподавателя.</p> <p>Следует предварительно изучить методические указания по выполнению контрольной работы Лашкова И.А. Методические указания по выполнению контрольной работы студентами заочной формы обучения направления 38.04.01 – «Экономика» по дисциплине «Эконометрика (продвинутый уровень)» – СПб.: СПГУТД, 2015. – 32 с. (содержание дисциплины, темы контрольных работ, вопросы к зачету, тестовые задания). Режим доступа: http://www.publish.sutd.ru.</p> <p>При подготовке к зачету необходимо ознакомиться с демонстрационным вариантом задания (перечнем вопросов, пр.), проработать конспекты лекций и практических занятий, рекомендуемую литературу, получить консультацию у преподавателя, подготовить презентацию материалов</p>

10. ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

10.1. Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

10.1.1. Показатели оценивания компетенций на этапах их формирования

Код компетенции / этап освоения	Показатели оценивания компетенций	Наименование оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
ОК-1/1	Формулирует и интерпретирует основные закономерности функционирования экономики на макро- и микроуровне, используя современные методы эконометрического анализа	Вопросы для устного собеседования	Перечень вопросов для устного собеседования (12 вопросов);

Код компетенции / этап освоения	Показатели оценивания компетенций	Наименование оценочного средства	Представление оценочного средства в фонде
	Решает типовые задачи по основным разделам эконометрики с использованием соответствующих программных продуктов	Практическое типовое задание	Перечень типовых заданий (5 вариантов);
	Выбирает и объясняет применение современного инструментария для микроэкономического и макроэкономического моделирования		
ОПК-1/1 ...	Формулирует особенности построения эконометрических моделей, позволяющих при наличии различной информации решать разные эконометрические задачи, используя современные эконометрические методы	Вопросы для устного собеседования	Перечень вопросов для устного собеседования (13 вопросов);
	Решает типовые задачи по основным разделам эконометрики	Практическое типовое задание	Перечень типовых заданий (5 вариантов);
	Выбирает и обосновывает методики и методологии проведения научных исследований построения эконометрических моделей.		
ПК-9/1 ...	Излагает приемы выявления формы аналитической зависимости между экономическими явлениями.	Вопросы для устного собеседования	Перечень вопросов для устного собеседования (13 вопросов);
	Выбирает аналитическую форму аналитической модели на основе эмпирических данных, либо на основе априорной информации об исследуемых экономических явлениях.	Практическое типовое задание	Перечень типовых заданий (5 вариантов);
	Решает экономические задачи с помощью методов эконометрики.		

10.1.2. Описание шкал и критериев оценивания сформированности компетенций Критерии оценивания сформированности компетенций

Баллы	Оценка по традиционной шкале	Критерии оценивания сформированности компетенций
		Устное собеседование
40 – 100	Зачтено	Обучающийся своевременно выполнил практическое типовое задание и представил результаты в письменной форме или в форме презентации (Microsoft Office Power Point); в соответствии с требованиями выполнил практическое типовое задание по дисциплине, возможно допуская несущественные ошибки в ответе на вопросы преподавателя. Учитываются баллы, накопленные в течение семестра.
0 – 39	Не зачтено	Обучающийся не выполнил (выполнил частично) практическое типовое задание, не представил результаты в письменной форме или в форме презентации (Microsoft Office Power Point); не смог изложить содержание и выводы своего практического типового задания, допустил существенные ошибки в ответе на вопросы преподавателя. Не учитываются баллы, накопленные в течение семестра.

10.2. Типовые контрольные задания или иные материалы, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующие этапы формирования компетенций

10.2.1. Перечень вопросов (тестовых заданий), разработанный в соответствии с установленными этапами формирования компетенций

№ п/п	Формулировка вопросов	№ темы
1	Возникновение и развитие эконометрики. Парная регрессия. Свойства остатков модели парной регрессии.	1,2
2	Множественная линейная регрессия в скалярной и векторной форме. Метод наименьших квадратов (МНК) и предпосылки его применения. Следствия выполнения предпосылок Гаусса – Маркова.	3
3	Изучение тесноты связи по множественной регрессии. Проверка значимости модели множественной регрессии и ее параметров.	3
4	Множественная линейная регрессия с ограничениями на параметры.	3
5	Нелинейные модели множественной регрессии. Выбор наилучшей функции регрессии.	4

6	Метод максимального правдоподобия. Прогнозирование по модели множественной регрессии. Мультиколлинеарность данных.	4
7	Гетероскедастичность данных. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК).	5
8	Особенности включения в модели регрессии неколичественных показателей. Спецификация моделей регрессии с фиктивными независимыми переменными.	6
9	Модели регрессии с фиктивными переменными сдвига и наклона. Общий вид модели регрессии с фиктивными переменными. Тест Чоу.	6
10	Виды систем эконометрических уравнений и методы их оценивания.	7
11	Системы одновременных уравнений. Уравнения, кажущиеся несвязанными.	7
12	Компоненты динамического ряда. Автокорреляция уровней динамического ряда и характеристика его структуры.	8
13	Модели тенденции развития. Моделирование периодических колебаний.	8
14	Специфика изучения взаимосвязей по рядам динамики. Учет тенденции при построении модели регрессии	9
15	ОМНК при построении модели регрессии по временным рядам	9
16	Учет сезонности при построении модели регрессии	9
17	Модели с лаговыми переменными. Общая характеристика.	10
18	Модели с распределенными лагами.	10
19	Модели авторегрессии. Авторегрессионные процессы и их моделирование (общая характеристика).	10
20	Стационарный ряд. Базовые модели временных рядов.	11
21	Теорема декомпозиции Вольда. Частная автокорреляционная функция.	11
22	Модель ARMA. Модель ARIMA. Кointеграция. Модели ARCH и GARCH.	11
23	Панельные данные и их преимущества	12
24	Однонаправленные модели панельных данных. Качество подготовки. Выбор модели.	12
25	Двунаправленная модель панельных данных с фиксированными эффектами.	12

10.2.2. Перечень тем докладов (рефератов, эссе, пр.), разработанных в соответствии с установленными этапами формирования компетенций

Вариант типовых заданий (задач, кейсов), разработанных в соответствии с установленными этапами формирования компетенций

№ п/п	Условия типовых задач (задач, кейсов)	Ответ																									
1	<p>Дана модель вида</p> $y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + b_3x_3 + \varepsilon$ <p>Определить количество объясняющих переменных</p>	<p>3</p> <p><i>Развернутый ответ.</i> Эконометрическая модель уравнения регрессии может быть представлена линейным уравнением множественной регрессии в виде выражения</p> $y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + \dots + b_jx_j + \dots + b_kx_k + \varepsilon$ <p>где y – зависимая переменная; x_j – объясняющая независимая переменная ($j = 1, \dots, k$; k – количество независимых переменных); a, b_j – параметры (a – свободный член уравнения, b_j – коэффициент регрессии); ε – случайные факторы. Независимые переменные x_j называются также факторами, объясняющими переменными. На количество объясняющих переменных в линейном уравнении указывает также количество коэффициентов регрессии b_j. Поэтому количество объясняющих переменных в модели равно 3.</p>																									
2	<p>Дана матрица парных коэффициентов корреляции.</p> <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tr><td></td><td>y</td><td>x_1</td><td>x_2</td><td></td></tr> <tr><td>y</td><td>1</td><td>-</td><td>-</td><td></td></tr> <tr><td>x_1</td><td>0,987</td><td>1</td><td>-</td><td></td></tr> <tr><td>x_2</td><td>0,754</td><td>0,451</td><td>1</td><td></td></tr> <tr><td>x_3</td><td>0,857</td><td>0,789</td><td>0,154</td><td>1</td></tr> </table> <p>Какие факторы являются коллинеарными?</p>		y	x_1	x_2		y	1	-	-		x_1	0,987	1	-		x_2	0,754	0,451	1		x_3	0,857	0,789	0,154	1	<p>Факторы X_1 и X_3 коллинеарны.</p> <p><i>Развернутый ответ.</i></p> <p>Считается, что две переменные явно коллинеарны, т.е. находятся между собой в линейной зависимости,</p> $ r_{x_i x_j} \geq 0,7$ <p>если $r_{x_1 x_3} = 0,789 \geq 0,7$. В нашей модели только коэффициент парной линейной регрессии между факторами X_1 и X_3 больше 0,7.</p> <p>значит, факторы X_1 и X_3 коллинеарны.</p>
	y	x_1	x_2																								
y	1	-	-																								
x_1	0,987	1	-																								
x_2	0,754	0,451	1																								
x_3	0,857	0,789	0,154	1																							
3	<p>Модель мультипликатора-акселератора Кейнса</p>	<p>C и y – эндогенные переменные; I – экзогенная переменная.</p> <p><i>Развернутый ответ.</i> В модели мультипликатора-акселератора Кейнса эндогенными переменными являются переменные C (личное потребление в постоянных ценах)</p>																									

	$\begin{cases} C = a + b \cdot y + \varepsilon, \\ y = C + I \end{cases}$ <p>где C – личное потребление в постоянных ценах, y – национальный доход в постоянных ценах, I – инвестиции в постоянных ценах, ε – случайная составляющая, Укажите какие переменные являются эндогенными: а какие экзогенными переменными?</p>	<p>и y (национальный доход в постоянных ценах). А экзогенными является только переменная I (инвестиции в постоянных ценах). И ε является случайной составляющей.</p>																																																	
4...	<p>Дана таблица исходных данных для построения эконометрической регрессионной модели:</p> <table border="1" data-bbox="252 591 807 913"> <thead> <tr> <th>Номер наблюдений</th> <th>Размер заработной платы (рублей), y</th> <th>Уровень образования, x_1</th> <th>Стаж работы (лет), x_2</th> <th>Уровень квалификации работника, x_3</th> <th>Производительность труда (ед. продукции час), x_4</th> <th>Количество отработанных дней в месяце (дней), x_5</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>1</td> <td>12500</td> <td>вышее</td> <td>5</td> <td>средний</td> <td>2,1</td> <td>14</td> </tr> <tr> <td>2</td> <td>10000</td> <td>среднее</td> <td>10</td> <td>средний</td> <td>2,3</td> <td>15</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td>11000</td> <td>среднее</td> <td>3</td> <td>средний</td> <td>1,8</td> <td>20</td> </tr> <tr> <td>4</td> <td>11700</td> <td>среднее</td> <td>7</td> <td>высокий</td> <td>2,6</td> <td>16</td> </tr> <tr> <td>...</td> <td>...</td> <td>...</td> <td>...</td> <td>...</td> <td>...</td> <td>...</td> </tr> <tr> <td>n</td> <td>11200</td> <td>среднее</td> <td>8</td> <td>высокий</td> <td>2,1</td> <td>18</td> </tr> </tbody> </table> <p>Какие переменные в этой таблице не являются фиктивными?</p>	Номер наблюдений	Размер заработной платы (рублей), y	Уровень образования, x_1	Стаж работы (лет), x_2	Уровень квалификации работника, x_3	Производительность труда (ед. продукции час), x_4	Количество отработанных дней в месяце (дней), x_5	1	12500	вышее	5	средний	2,1	14	2	10000	среднее	10	средний	2,3	15	3	11000	среднее	3	средний	1,8	20	4	11700	среднее	7	высокий	2,6	16	n	11200	среднее	8	высокий	2,1	18	<p>Размер заработной платы</p> <p>Стаж работы.</p> <p>Производительность труда.</p> <p>Количество отработанных дней</p> <p>вернутый ответ. При построении регрессионной модели может возникнуть ситуация, когда необходимо включить в уравнение помимо количественных переменных переменные, обозначающие некоторые атрибутивные признаки (пол, образование, регион и т.п.). Такого рода качественные переменные называются «фиктивными» (dummy) переменными. Для построения указанной в постановке задачи модели используются фиктивные переменные: уровень образования и уровень квалификации работника. Остальные переменные не являются фиктивными, из предложенных вариантов это размер заработной платы, стаж работы, производительность труда и количество отработанных дней.</p>
Номер наблюдений	Размер заработной платы (рублей), y	Уровень образования, x_1	Стаж работы (лет), x_2	Уровень квалификации работника, x_3	Производительность труда (ед. продукции час), x_4	Количество отработанных дней в месяце (дней), x_5																																													
1	12500	вышее	5	средний	2,1	14																																													
2	10000	среднее	10	средний	2,3	15																																													
3	11000	среднее	3	средний	1,8	20																																													
4	11700	среднее	7	высокий	2,6	16																																													
...																																													
n	11200	среднее	8	высокий	2,1	18																																													
5	<p>Для аддитивной модели временного ряда $Y = T + S + E$ лаг модели равен 4 и известны значения трех скорректированных сезонных компонент:</p> $S_1 = 2, S_2 = -1, S_3 = -2$ <p>Чему равна скорректированная сезонная компонента S_4?</p>	<p>$S_4 = 1$</p> <p>Развернутый ответ. Для аддитивной модели временного ряда $Y = T + S + E$ сумма скорректированных сезонных компонент равна нулю.</p> $S_1 + S_2 + S_3 + S_4 = 0$ <p>Значит, $S_4 = -2 + 1 + 2 = 1$.</p>																																																	

10.3. Методические материалы,

определяющие процедуры оценивания знаний, умений, владений (навыков и (или) практического опыта деятельности), характеризующих этапы формирования компетенций

10.3.1. Условия допуска обучающегося к сдаче (зачета) и порядок ликвидации академической задолженности

Положение о проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся (принято на заседании Ученого совета)

10.3.2. Форма проведения промежуточной аттестации по дисциплине

устная письменная компьютерное тестирование иная*

10.3.3. Особенности проведения (зачета)

На подготовку по теоретическому вопросу дается 20 минут.

Для выполнения практического задания студенту выделяется 40 минут.