

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ОРЕНБУРГСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.Б.05 Эконометрика (продвинутый уровень)

Направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

Профиль подготовки Корпоративные финансы и оценка стоимости бизнеса

Квалификация (степень) выпускника магистр

Форма обучения заочная

1. Цели освоения дисциплины

Целями освоения дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» являются: продолжение углубленного рассмотрения методологии эконометрического моделирования социально-экономических процессов и практическое овладение приемами, позволяющими получать количественные выражения закономерностям экономической теории на базе экономической статистики с использованием математико-статистического инструментария.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Эконометрика (продвинутый уровень)» относится к базовой части. Требования к предшествующим знаниям представлены в таблице 2.1. Перечень дисциплин, для которых дисциплина «Эконометрика (продвинутый уровень)» является основополагающей, представлен в табл. 2.2.

Таблица 2.1 – Требования к пререквизитам дисциплины

Дисциплина	Раздел
Прогнозирование и управление денежными потоками	1,2
Статистика (продвинутый уровень)	1, 2

Таблица 2.2 – Требования к постреквизитам дисциплины

Дисциплина	Раздел
Моделирование финансовых рынков	1, 2

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

Таблица 3.1 – Взаимосвязь планируемых результатов обучения по дисциплине и планируемых результатов освоения образовательной программы

Индекс и содержание компетенции	Знания	Умения	Навыки и (или) опыт деятельности
ПК-2: способностью анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов	1 этап: сущность экономических процессов и явлений 2 этап: понятие управленческого решения	1 этап: применять современный математический инструментарий для решения содержательных экономических задач 2 этап: выбирать необходимый эконометрический инструментарий	1 этап: навык работы с периодической, научной литературой 2 этап: навык работы с информационной литературой
ПК-20: способностью осуществлять разработку теоретических и новых эконометрических моделей исследуемых процессов, явлений и объектов, относящихся	1 этап: основы эконометрического моделирования 2 этап: современные методы эконометрического анализа	1 этап: формировать прогнозы развития конкретных экономических процессов на макро-, микро- и мезоуровне 2 этап: интерпретировать	1 этап: навык обоснования методики расчетов 2 этап: прогнозирование по эконометрической

к сфере профессиональной финансовой деятельности в области финансов и кредита, давать оценку и интерпретировать полученные в ходе исследования результаты		полученные результаты	модели
---	--	-----------------------	--------

4. Объем дисциплины

Объем дисциплины «Эконометрика (продвинутый уровень)» составляет 3 зачетных единиц (108 академических часов), распределение объема дисциплины на контактную работу обучающихся с преподавателем (КР) и на самостоятельную работу обучающихся (СР) по видам учебных занятий и по периодам обучения представлено в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Распределение объема дисциплины по видам учебных занятий и по периодам обучения, академические часы

№ п/п	Вид учебных занятий	Итого КР	Итого СР	Семестр № 3		Семестр № 4	
				КР	СР	КР	СР
1	2	3	4	5	6	7	8
1	Лекции (Л)	-	-	-	-	-	-
2	Лабораторные работы (ЛР)	8	-	6	-	2	-
3	Практические занятия (ПЗ)	4	-	2	-	2	-
4	Семинары (С)	-	-	-	-	-	-
5	Курсовое проектирование (КП)	2	20	-	10	2	10
6	Рефераты (Р)	-	-	-	-	-	-
7	Эссе (Э)	-	-	-	-	-	-
8	Индивидуальные домашние задания (ИДЗ)	-	-	-	-	-	-
9	Самостоятельное изучение вопросов (СИБ)	-	44	-	34	-	10
10	Подготовка к занятиям (ПкЗ)		26	-	20	-	6
11	Промежуточная аттестация (ПА)	4	-	-	-	4	-
12	Наименование вида промежуточной аттестации	х	х	-	-	экзамен	
13	Всего	18	90	8	64	10	26

5. Структура и содержание дисциплины

Структура дисциплины представлена в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Структура дисциплины

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Объем работы по видам учебных занятий, академические часы										Коды формируемых компетенций
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	курсовое проектирование	рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	промежуточная аттестация	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
1.	Раздел 1 Эконометрические модели и проблемы эконометрического моделирования	3	х	2	-	х	х	х	х	12	4	х	ПК-2 ПК-20
1.1.	Тема 1 Основные аспекты построения эконометрических моделей	3	х	1	-	х	х	х	х	6	2	х	ПК-2 ПК-20
1.2.	Тема 2 Основные проблемы эконометрического моделирования.	3	х	1	-	х	х	х	х	6	2	х	ПК-2 ПК-20
2.	Раздел 2 Регрессионные модели социальных и экономических процессов	3	х	2	2	х	х	х	х	12	4	х	ПК-2 ПК-20
2.1.	Тема 3 Построение линейной и нелинейных моделей регрессии. Оценка их адекватности.	3	х	1	1	х	х	х	х	6	2	х	ПК-2 ПК-20
2.2.	Тема 4 Точечный и интервальный прогноз по моделям регрессии.	3	х	1	1	х	х	х	х	6	2	х	ПК-2 ПК-20
3.	Раздел 3 Эконометрическое моделирование и прогнозирование временных рядов	3	х	2	-	х	х	х	х	10	12	х	ПК-2 ПК-20
3.1.	Тема 5 Моделирование одномерных временных рядов	3	х	1	-	х	х	х	х	5	6	х	ПК-2 ПК-20

№ п/п	Наименования разделов и тем	Семестр	Объем работы по видам учебных занятий, академические часы										Коды формируемых компетенций
			лекции	лабораторная работа	практические занятия	семинары	курсовое проектирование	рефераты (эссе)	индивидуальные домашние задания	самостоятельное изучение вопросов	подготовка к занятиям	промежуточная аттестация	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14
3.2.	Тема 6 Моделирование взаимосвязанных временных рядов.	3	х	1	-	х	х	х	х	5	6	х	ПК-2 ПК-20
4.	Контактная работа	3	х	6	2	х	х	х	х	х	х	х	х
5.	Самостоятельная работа	3	х	х	х	х	10	х	х	34	20	х	х
6.	Объем дисциплины в семестре	3	х	6	2	х	10	х	х	34	20	х	х
7.	Раздел 4 Эконометрические модели из линейных уравнений	4	х	2	2	х	-	х	х	14	6	-	ПК-2 ПК-20
7.1.	Тема 7 Проблемы идентификации эконометрических моделей из линейных уравнений.	4	х	1	1	х	-	х	х	8	3	-	ПК-2 ПК-20
7.2.	Тема 8 Методы оценивания эконометрических моделей из линейных уравнений.	4	х	1	1	х	2	х	х	6	3	4	ПК-2 ПК-20
8	Контактная работа	4	х	2	2	х	2	х	х	х	х	4	х
9.	Самостоятельная работа	4	х	х	х	х	10	х	х	10	6	х	х
10.	Объем дисциплины в семестре	4	х	2	2	х	12	х	х	10	6	4	х
11.	Всего по дисциплине	3,4	х	8	4	х	22	х	х	44	26	4	х

5.2. Содержание дисциплины

5.2.1 – Темы лабораторных работ

№ п.п.	Наименование темы лекции	Объем, академические часы
ЛР-1	Основные аспекты построения эконометрических моделей	1
	Основные проблемы эконометрического моделирования	1
ЛР-2	Построение линейной и нелинейных моделей регрессии. Оценка их адекватности	1
	Точечный и интервальный прогноз по моделям регрессии	1
ЛР-3	Моделирование одномерных временных рядов	1
	Моделирование взаимосвязанных временных рядов	1
ЛР-4	Проблемы идентификации эконометрических моделей из линейных уравнений	1
	Методы оценивания эконометрических моделей из линейных уравнений	1
Итого по дисциплине		8

5.2.2 – Темы практических занятий

№ п.п.	Наименование темы лекции	Объем, академические часы
ПЗ-1	Построение линейной и нелинейных моделей регрессии. Оценка их адекватности	1
	Точечный и интервальный прогноз по моделям регрессии	1
ПЗ-2	Проблемы идентификации эконометрических моделей из линейных уравнений	1
	Методы оценивания эконометрических моделей из линейных уравнений	1
Итого по дисциплине		4

5.2.3 Темы курсовых работ (проектов)

1. Эконометрическое моделирование уровня и качества жизни населения (страна, область, район)
2. Эконометрическое моделирование уровня и динамики заработной платы (страна, область, район)
3. Эконометрическое моделирование доходов и расходов населения (страна, область, район)
4. Эконометрическое моделирование занятости и безработицы (страна, область, район)
5. Эконометрическое моделирование демографических процессов (страна, область, район)
6. Эконометрическое моделирование дифференциации регионов России по демографическим показателям
7. Эконометрическое моделирование естественного прироста населения (страна, область, район)
8. Эконометрическое моделирование миграционных процессов (страна, область, район)

9. Эконометрическое моделирование уровня динамики брачности и разводимости в (страна, область, район)
10. Эконометрическое моделирование использования трудовых ресурсов (страна, область, район, предприятие).
11. Эконометрическое моделирование состояния и тенденций развития системы образования (страна, область, район)
12. Эконометрическое моделирование уровня образования населения в (страна, область, район)
13. Эконометрическое моделирование состояния и перспектив развития системы здравоохранения регионов
14. Эконометрическое моделирование состояния и охраны здоровья населения (страна, область, район)
15. Эконометрическое моделирование жилищного фонда (страна, область, район)
16. Эконометрическое моделирование показателей состояния и охраны окружающей среды (страна, область)
17. Эконометрическое моделирование структуры и динамики ВВП Российской Федерации
18. Эконометрическое моделирование внешнеэкономических связей России
19. Эконометрическое моделирование внешней торговли России
20. Эконометрическое моделирование тенденций в развитии внутренней и внешней торговли (страна, область район)
21. Эконометрическое моделирование платежного баланса (страна, область)
22. Эконометрическое моделирование денежного обращения в России
23. Эконометрическое моделирование денежно-кредитной системы России
24. Эконометрическое моделирование и прогнозирование закономерностей изменения курса валют
25. Эконометрическое моделирование и прогнозирование индикаторов фондового рынка
26. Эконометрическое моделирование темпов строительства в (область, страна)
27. Эконометрическое моделирование основных показателей деятельности транспорта в (страна, область, район)
28. Эконометрическое моделирование тенденции и сезонности производства молока (на примере предприятия)
29. Эконометрическое моделирование динамики валового сбора и урожайности зерновых культур (страна, область, район, предприятие)
30. Эконометрическое моделирование и прогнозирование урожайности подсолнечника в (страна, область, район)
31. Эконометрическое моделирование воспроизводства основных фондов и инвестиций в развитии народного хозяйства России (область)
32. Эконометрическое моделирование тенденции изменения товарной структуры розничного товарооборота (страна, область, район)
33. Эконометрическое моделирование потребительского спроса населения (страна, область, район) Организация государственной статистики в Российской Федерации и международной статистики
34. Статистические группировки и классификации, применяемые в статистике для анализа социально-экономических явлений (с рассмотрением практического примера)
35. Эконометрическое моделирование уровня и динамики заработной платы (страна, область, район)

5.2.4 – Вопросы для самостоятельного изучения

5.2.4 Вопросы для самостоятельного изучения			
№ п.п.	Наименования темы	Наименование вопроса	Объем, академические часы
1.	Основные аспекты построения эконометрических моделей	Эконометрика: эволюция определения и реальность	2
		Эконометрика и ее место в ряду статистических, математических и экономических дисциплин	2
		Сущность эконометрической модели	2
2.	Основные проблемы эконометрического моделирования	Обеднение математического аппарата эконометрики	3
		Проблема спецификации модели	3
3.	Построение линейной и нелинейных моделей регрессии. Оценка их адекватности	Адекватность линейной модели	3
		Адекватность нелинейной модели	3
4.	Точечный и интервальный прогноз по моделям регрессии	Анализ точности регрессионной модели	2
		Прогнозирование в условиях реалистической ситуации	2
		Интерпретация прогнозных значений	2
5.	Моделирование одномерных временных рядов	Критерии проверки временного ряда на стационарность	2
		Прогнозирование по одномерному временному ряду	3
6.	Моделирование взаимосвязанных временных рядов	Понятие взаимосвязанных временных рядов	2
		Моделирование и прогнозирование по взаимосвязанному временному ряду	3
7.	Проблемы идентификации эконометрических моделей из линейных уравнений	Виды систем эконометрических уравнений Структурная и приведенная формы модели	4
		Проблема идентификации. Необходимое и достаточное условие идентификации	4
8.	Методы оценивания эконометрических моделей из линейных уравнений	Оценка точно идентифицированного уравнения	3
		Оценка сверхидентифицированного уравнения	3
Итого по дисциплине			44

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1 Основная литература, необходимая для освоения дисциплины

1. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебник/ К.В. Балдин [и др.].— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2015.— 562 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/5265>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Буравлёв А.И. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Буравлёв А.И.— Электрон. текстовые данные.— М.: БИНОМ. Лаборатория знаний, 2014.— 165 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/12284>.— ЭБС «IPRbooks»

6.2 Дополнительная литература, необходимая для освоения дисциплины

1. Мхитарян В.С. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебное пособие/ Мхитарян В.С., Архипова М.Ю., Сиротин В.П.— Электрон. текстовые данные.— М.: Евразийский открытый институт, 2012.— 224 с.— Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/11125>.— ЭБС «IPRbooks»
2. Тимофеев В.С. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебник для академического бакалавриата/ Тимофеев В.С., Фаддеенков А.В., Щеколдин В.Ю. - 2-е изд., пер. и доп. — М.: Издательство ЮРАЙТ, 2016. — 328с. — .— Режим доступа: <https://www.biblio-online.ru/viewer/BEF2D090-8DD0-4C77-AB7E-7F72687FED11#page/2>.— ЭБС «ЮРАЙТ»

6.3 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины и другие материалы к занятиям

- 1) Электронное учебное пособие включающее:
 - методические указания по выполнению лабораторных работ;
 - методические указания по выполнению практических заданий.
- 2) Лаптева Е.В. Рабочая тетрадь по эконометрике для студентов специальности «Экономическая безопасность» и направления подготовки «Экономика», обучающихся в высших учебных заведениях [электронный ресурс]. – Оренбург: 2015.- 66 с.

6.4 Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

- Электронное учебное пособие включающее:
- методические рекомендации для студентов по самостоятельной работе;
 - методические рекомендации для студентов по подготовке к занятиям;
 - методические рекомендации по выполнению курсовой работы (проекта).

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

1. OpenOffice
2. MS Excel
3. JoliTest

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

1. ЭБС «ЮРАЙТ» www.biblio-online.ru
2. ЭБС "Лань": www.e.lanbook.com/
3. ЭБС "iBooks.ru": www.iBooks.ru/
4. eLIBRARY.RU: www.elibrary.ru/
5. Википедия: <https://ru.wikipedia.org/>

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

Занятия лекционного типа проводятся в аудитории, оборудованной мультимедиапроектором, компьютером, учебной доской.

Таблица 7.1 – Материально-техническое обеспечение лабораторных работ

Номер ПЗ	Тема лабораторной работы	Название специализированной лаборатории	Название спецоборудования	Название технических и электронных средств обучения и контроля знаний
ЛР-1	Основные аспекты построения эконометрических моделей	Компьютерный класс	Системный блок, монитор, клавиатура, мышь	MS Excel, JoliTest Презентация в OpenOffice
	Основные проблемы эконометрического моделирования			
ЛР-2	Построение линейной и нелинейных моделей регрессии. Оценка их адекватности			
	Точечный и интервальный прогноз по моделям регрессии			
ЛР-3	Моделирование одномерных временных рядов			
	Моделирование взаимосвязанных временных рядов			
ЛР-4	Проблемы идентификации эконометрических моделей из линейных уравнений			
	Методы оценивания эконометрических моделей из линейных уравнений			

Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине представлен в Приложении 1.

Программа разработана в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, утвержденным приказом Министерства образования и науки РФ от 30 марта 2015 г. № 325

Разработал(и): _____

Е.В.Лаптева,
Т.В. Тимофеева