

МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Воронежский государственный аграрный университет имени императора Петра I»

Экономический факультет

Кафедра экономического анализа, статистики и прикладной математики

Эконометрика (продвинутый уровень)

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины
Направление подготовки: **38.04.01 Экономика**

Профили: «Учетно-аналитическое обеспечение бизнеса», «Бухгалтерский
учет контроль», «Корпоративный финансовый менеджмент»,
«Экономика фирмы и отраслевых рынков»

Воронеж 2017

Шишкина Л.А. Эконометрика (продвинутый уровень): Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (направление подготовки 38.04.01 Экономика: профили: «Учетно-аналитическое обеспечение бизнеса», «Бухгалтерский учет контроль», «Корпоративный финансовый менеджмент», «Экономика фирмы и отраслевых рынков») / Л.А. Шишкина. – Воронеж: ВГАУ, 2017 – 8 с.

Рецензент: к.э.н., доцент кафедры финансов и кредита федерального государственного образовательного учреждения высшего образования «Воронежский государственный аграрный университет имени императора Петра I» Л.Н. Сотникова

Методические указания рассмотрены и рекомендованы к изданию на заседании кафедры экономического анализа, статистики и прикладной математики (протокол № 5 от 16 мая 2017 г.)

Методические указания рассмотрены и рекомендованы к изданию на заседании методической комиссии экономического факультета (протокол № 3 от 16 мая 2017 г.)

© Л.А. Шишкина

© ФГБОУ ВО Воронежский ГАУ

ВВЕДЕНИЕ

1. Цель изучения дисциплины состоит в изучении эконометрических методов исследования количественных и качественных закономерностей в экономике на основе анализа статистических данных.

Задачи преподавания дисциплины эконометрика (продвинутый уровень) состоят в том, чтобы показать сущность эконометрики как науки, расположенной между экономикой, статистикой и математикой; научить обучающихся использовать данные или наблюдения для построения количественных зависимостей для экономических соотношений, для выявления связей, закономерностей и тенденций развития экономических явлений, выработать у обучающихся умение формировать экономические модели, основываясь на экономической теории или на эмпирических данных, оценивать неизвестные параметры в этих моделях, делать прогнозы и оценивать их точность, давать рекомендации по экономической политике и хозяйственной деятельности.

Эконометрика (продвинутый уровень) объясняет совокупность методов и моделей, позволяющих на базе экономической теории, экономической статистики и математико-статистического инструментария придавать количественные выражения и анализировать экономические законы и закономерности. Навыки проведения эконометрического исследования статистических данных и экономических показателей, а также верной интерпретации результатов такого исследования, являются одной из важных составляющих современного экономического образования.

Дисциплина Эконометрика (продвинутый уровень) входит в базовую часть цикла подготовки магистра по направлению «Экономика» (шифр Б1.Б.03).

2. Требования к уровню освоения дисциплины.

Дисциплина нацелена на формирование компетенций:

Компетенция		К	Планируемые результаты
Код	Название		
ОК-1	способностью абстрактному мышлению, анализу, синтезу	к	Знать: основные методы сбора и анализа информации, способы формализации цели и методы ее достижения. Уметь: анализировать, обобщать и воспринимать информацию; ставить цель и формулировать задачи по её достижению. Иметь навыки абстрактного мышления.
ОК-3	готовностью саморазвитию, самореализации, использованию творческого потенциала	к	Знать: алгоритм научного поиска, алгоритм самореализации, саморазвития, характеристику основных элементов научной работы. Уметь: осуществлять этапы поиска авторского решения. Иметь навыки творческого решения

		задачи.
ОПК -3	способность принимать организационно-управленческие решения	Уметь определять критерии оценки финансово-экономической ситуации. Иметь навыки принятия управленческих решения для обеспечения конкурентоспособности экономических субъектов.
ПК-1	способностью обобщать и критически оценивать результаты, полученные отечественными и зарубежными исследователями, выявлять перспективные направления, составлять программу исследований	Знать микроэкономические модели, описывающие взаимодействие структурных и функциональных составляющих экономики; Уметь разрабатывать экономико-математические модели и осуществлять с их помощью анализ и прогнозирование экономических и финансовых процессов, оценивать параметры функционирования конкретного экономического объекта и формулировать рекомендации для принятия практических решений в условиях риска; Иметь навыки использования современного программного обеспечения.
ПК-2	способностью обосновывать актуальность, теоретическую и практическую значимость избранной темы научного исследования	Уметь самостоятельно обосновать актуальность, теоретическую и практическую значимость выбранной темы исследования. Формулировать ожидаемые результаты собственного исследования, оценивать их возможное теоретическое и практическое значение.
ПК-3	способностью проводить самостоятельные исследования в соответствии с разработанной программой	Знать методику построения стандартных теоретических моделей статистической обработки данных. Уметь грамотно использовать современное стандартное программное обеспечение (STATISTICA) в ходе проведения самостоятельного исследования.
ПК-4	способностью представлять результаты проведенного	Уметь выявлять тенденции изменения социально-экономических показателей. Уметь правильно структурировать, характеризовать и демонстрировать

	исследования научному сообществу в виде статьи или доклада	результаты эконометрических исследований. Иметь навыки в интерпретации полученных результатов, уметь оценивать их статистическую значимость и адекватность.
ПК-10	способностью составлять прогноз основных социально- экономических показателей предприятия, отрасли, региона и экономики в целом	Знать методику формирования прогнозов развития конкретных экономических процессов на предприятии, в отрасли, регионе и экономике в целом на микро- и макроуровне; Уметь оценивать качество и надежность полученных прогнозных результатов с помощью доверительных интервалов. Иметь навыки прогнозирования основных социально-экономических показателей предприятия, отрасли, региона и экономики в целом на микро- и макроуровне.

3. Цель методических рекомендаций - обеспечить обучающемуся оптимальную организацию процесса изучения дисциплины.

Процесс изучения дисциплины включает посещение лекций, практических занятий по расписанию, выполнение курсовой работы, самостоятельную работу обучающегося, а также прохождение текущего контроля знаний и промежуточной аттестации (сдача экзамена).

1. УКАЗАНИЯ ПО ИЗУЧЕНИЮ ТЕОРЕТИЧЕСКОЙ ЧАСТИ ДИСЦИПЛИНЫ

Изучение дисциплины требует систематического и последовательного накопления знаний, следовательно, пропуски отдельных тем не позволяют глубоко освоить предмет. Именно поэтому контроль над систематической работой обучающихся всегда находится в центре внимания кафедры. Обучающимся необходимо перед каждой лекцией просматривать рабочую программу дисциплины, доступную в электронной образовательной среде Университета <http://io.vsau.ru/>. Это позволит сэкономить время на записывание темы лекции, ее основных вопросов, рекомендуемой литературы; - на отдельные лекции приносить соответствующий материал на бумажных носителях, представленный лектором на портале или присланный на «электронный почтовый ящик группы» (таблицы, графики, схемы). Данный материал будет охарактеризован, прокомментирован, дополнен непосредственно на лекции; - перед очередной лекцией необходимо просмотреть по конспекту материал предыдущей лекции. При затруднениях в восприятии материала следует обратиться к основным литературным источникам. Если разобраться в материале опять не удалось, то обратитесь к

лектору (по графику его консультаций) или к преподавателю на практических занятиях. Не оставляйте «белых пятен» в освоении материала.

Учебная дисциплина включает следующие разделы.

Раздел 1. Сущность и история возникновения эконометрики.

- 1.1. О предмете исследований эконометрики.
- 1.2. Этапы развития эконометрики.

Раздел 2. Корреляционный анализ.

- 2.1. Действия с матрицами.
- 2.2. Парные и частные коэффициенты корреляции.
- 2.3. Доверительные интервалы и проверка значимости коэффициентов корреляции.

Раздел 3. Простая линейная регрессия. Метод наименьших квадратов (МНК).

- 3.1. Основные понятия регрессионного анализа
- 3.2. Нахождение параметров парной регрессии с помощью МНК.
- 3.3. Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии.
- 3.4. Доверительные интервалы и прогноз по уравнению парной регрессии.

Раздел 4. Множественная регрессия.

- 4.1. Постановка задачи.
- 4.2. МНК - оценки линейной регрессионной модели.
- 4.3. Оценки математического ожидания и ковариаций МНК- коэффициентов модели.
- 4.4. Оценка качества модели.
- 4.5. Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии и проверка гипотезы об их значимости.
- 4.6. Доверительный интервал для прогнозных значений зависимой переменной.
- 4.7. Эластичность. Применение эластичности в экономике.

Раздел 5. Проблема мультиколлинеарности факторов.

- 5.1. Проверка мультиколлинеарности факторов.
- 5.2. Метод главных компонент.
- 5.3. Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции. Процедура шаговой регрессии.

Раздел 6. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные).

- 6.1. Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными.
- 6.2. Тест Г. Чоу для проверки структурных изменений модели.
- 6.3. Выбор модели оптимальной сложности. Тесты Акайка и Шварца.
- 6.4. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация.

Раздел 7. Гетероскедастичность моделей, ее обнаружение и методы устранения гетероскедастичности.

- 7.1. Определение гетероскедастичности модели.
- 7.2. Тестирование гетероскедастичности.
- 7.3. Последствия гетероскедастичности.

7.4. Подходы к решению проблемы гетероскедастичности.

7.5. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Теорема Айткена и обобщенный метод наименьших квадратов.

Раздел 8. Характеристики временных рядов. Модели стационарных и нестационарных временных рядов, их идентификация.

8.1. Принципы разработки прогнозов.

8.2. Анализ и моделирование временных рядов.

8.3. Коррелограмма и ее применение.

8.4. Выделение тренда в случае нестационарного временного ряда.

8.5. Автокорреляция остатков.

8.6. Гармонический анализ временных рядов.

Раздел 9. Сглаживание временных рядов.

9.1. Линейные фильтры.

9.2. Простая скользящая средняя.

9.3. Методы взвешенных скользящих средних. Простое экспоненциальное сглаживание.

9.4. Элементы диалога в модуле системы STATISTICA: анализ временных рядов, прогнозирование.

Раздел 10. Система линейных одновременных уравнений. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

10.1. Обзор основных понятий.

10.2. Идеи, лежащие в основе структурного моделирования.

10.3. Моделирование структурными уравнениями и диаграммы путей.

10.4. Косвенный, двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов.

Раздел 11. Модели финансовой эконометрики

11.1. Объекты и гипотезы финансовой эконометрики

11.2 Модели финансовых процессов с изменяющейся вариацией

11.2 Модели временных рядов финансовых показателей с нелинейными структурами

11.3 Исследование временных рядов методами нелинейной динамики. Прогнозирование урожайности, осадков и температур, фьючерсов на погоду на основе метода «ЗОНТ».

2. УКАЗАНИЯ ПО ПОДГОТОВКЕ К ПРАКТИЧЕСКИМ ЗАНЯТИЯМ

Рекомендации по подготовке к практическим занятиям Обучающимся следует:

– приносить с собой рекомендованную преподавателем литературу к конкретному занятию;

– до очередного практического занятия по рекомендованным литературным источникам проработать теоретический материал, соответствующей темы занятия;

– при подготовке к практическим занятиям следует обязательно использовать не только лекции, учебную литературу, но и нормативно-правовые акты и материалы правоприменительной практики;

– теоретический материал следует соотносить с правовыми нормами, так как в них могут быть внесены изменения, дополнения, которые не всегда отражены в учебной литературе.

В начале занятий следует задать преподавателю вопросы по материалу, вызвавшему затруднения в его понимании и освоении при решении задач, заданных для самостоятельного решения; - в ходе практического занятия необходимо давать конкретные, четкие ответы по существу вопросов; - на занятии важно доводить каждую задачу до окончательного решения, демонстрировать понимание проведенных расчетов (анализов, ситуаций), в случае затруднений обращаться к преподавателю. Обучающимся, пропустившим занятия (независимо от причин), не имеющие письменного решения задач или не подготовившиеся к данному практическому занятию, рекомендуется не позже чем в 2-недельный срок явиться на консультацию к преподавателю и отчитаться по теме, изучавшийся на занятии. Обучающиеся, не отчитавшиеся по каждой не проработанной ими на занятиях теме к началу зачетной сессии, упускают возможность получить положенные баллы за работу в соответствующем семестре.

3. УКАЗАНИЯ ПО ОРГАНИЗАЦИИ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ

Самостоятельная работа обучающихся включает в себя выполнение различного рода заданий, которые ориентированы на более глубокое усвоение материала изучаемой дисциплины. По каждой теме учебной дисциплины обучающимся предлагается перечень заданий для самостоятельной работы. К выполнению заданий для самостоятельной работы предъявляются следующие требования: задания должны исполняться самостоятельно и представляться в установленный срок, а также соответствовать установленным требованиям по оформлению. Обучающимся следует выполнять все плановые задания, выдаваемые преподавателем для самостоятельного выполнения. С этой целью следует использовать следующие методические указания: Шишкина Л.А. Эконометрика (продвинутый уровень): Методические указания по самостоятельной работе обучающихся (направление подготовки 38.04.01 Экономика: магистерские программы: «Учетно-аналитическое обеспечение бизнеса», «Бухгалтерский учет контроль», «Корпоративный финансовый менеджмент», «Экономика фирмы и отраслевых рынков», «Экономика фирмы и отраслевых рынков») / Л.А. Шишкина. – Воронеж: ВГАУ, 2017 – 16 с.

4. ПОДГОТОВКА К ТЕКУЩЕМУ КОНТРОЛЮ ЗНАНИЙ И ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Целью текущего контроля знаний со стороны преподавателя является оценка качества освоения обучающимися данной дисциплины в течение всего

периода ее изучения. К главной задаче текущего контроля относится повышение мотивации обучающихся к регулярной учебной работе, самостоятельной работе, углублению знаний, дифференциации итоговой оценки знаний.

Преподаватель, осуществляющий текущий контроль, на первом занятии доводит до сведения обучающихся требования и критерии оценки знаний по дисциплине. В целях предупреждения возникновения академической задолженности (либо своевременной ее ликвидации) преподаватель проводит регулярные консультации и иные необходимые мероприятия в пределах учебных часов, предусмотренных учебным планом.

При преподавании данной дисциплины предусматриваются следующие формы текущего контроля знаний: текущий контроль в форме индивидуальных опросов, текущий контроль в форме тестирования и собеседования с обучающимися.

Промежуточная аттестация проводится в форме сдачи экзамена.

Подготовка к текущему контролю и промежуточной аттестации происходит как в ходе отдельных аудиторных занятий, так и во время внеаудиторной работы.

Полное описание фонда оценочных средств для текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся с перечнем компетенций, описанием показателей и критериев оценивания компетенций, шкал оценивания, типовые контрольные задания и методические материалы представлены в отдельном документе ФОС, доступном в электронной образовательной среде Университета <http://io.vsau.ru/>.