

МИНИСТЕРСТВО ТРАНСПОРТА РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ АВТОНОМНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ ТРАНСПОРТА»
(РУТ (МИИТ))



Рабочая программа дисциплины (модуля),
как компонент образовательной программы
высшего образования - программы бакалавриата
по направлению подготовки
38.03.01 Экономика,
утвержденной первым проректором РУТ (МИИТ)
Тимониным В.С.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Эконометрика

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Бухгалтерский учет, анализ и аудит

Форма обучения: Очная

Рабочая программа дисциплины (модуля) в виде
электронного документа выгружена из единой
корпоративной информационной системы управления
университетом и соответствует оригиналу

Простая электронная подпись, выданная РУТ (МИИТ)
ID подписи: 564169
Подписал: заведующий кафедрой Каргина Лариса Андреевна
Дата: 09.02.2022

1. Общие сведения о дисциплине (модуле).

Целями освоения дисциплины являются:

- изучение современных методов эконометрического моделирования;
- овладение навыками использования статистического инструментария с целью решения экономических и управленческих задач;
- развить критическое мышление и повысить общий уровень аналитической культуры.

Задачами освоения дисциплины является:

- формирование у обучающихся представления о многообразии современных подходов эконометрического моделирования;
- научить пониманию и использованию математического языка, на котором принято описывать современные эконометрические методы;
- привить критический подход при отборе инструментов анализа и осознание необходимости тщательного тестирования статистической адекватности получаемых моделей;
- развить навыки содержательной интерпретации результатов.

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю).

Перечень формируемых результатов освоения образовательной программы (компетенций) в результате обучения по дисциплине (модулю):

ОПК-1 - Способен применять знания (на промежуточном уровне) экономической теории при решении прикладных задач;

ОПК-2 - Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач.

Обучение по дисциплине (модулю) предполагает, что по его результатам обучающийся будет:

Знать:

- основные понятия эконометрики;
- основные методы оценивания неизвестных параметров эконометрических моделей;
- методы проверки статистических гипотез о параметрах построенных моделей;
- основные методы диагностики (проверки качества) эконометрических моделей;
- основные приложения эконометрического анализа.

Уметь:

- находить данные, необходимые для проведения эконометрического исследования;
- формулировать задачу в пригодном для эконометрического исследования виде;
- применять стандартные методы построения эконометрических моделей;
- обрабатывать статистическую информацию и получать статистически обоснованные выводы;
- давать содержательную интерпретацию результатов эконометрического моделирования.

Владеть:

- навыками эконометрического исследования;
- навыками обработки реальных статистических данных;
- навыками построения и диагностики эконометрических моделей;
- навыками интерпретации основных результатов оценки моделей;
- навыками применения статистических пакетов для построения и диагностики эконометрических моделей.

3. Объем дисциплины (модуля).**3.1. Общая трудоемкость дисциплины (модуля).**

Общая трудоемкость дисциплины (модуля) составляет 7 з.е. (252 академических часа(ов)).

3.2. Объем дисциплины (модуля) в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении учебных занятий:

Тип учебных занятий	Количество часов		
	Всего	Семестр	
		№3	№4
Контактная работа при проведении учебных занятий (всего):	116	48	68
В том числе:			
Занятия лекционного типа	50	16	34
Занятия семинарского типа	66	32	34

3.3. Объем дисциплины (модуля) в форме самостоятельной работы

обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации составляет 136 академических часа (ов).

3.4. При обучении по индивидуальному учебному плану, в том числе при ускоренном обучении, объем дисциплины (модуля) может быть реализован полностью в форме самостоятельной работы обучающихся, а также в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками и (или) лицами, привлекаемыми к реализации образовательной программы на иных условиях, при проведении промежуточной аттестации.

4. Содержание дисциплины (модуля).

4.1. Занятия лекционного типа.

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
1	<p>Предмет эконометрики.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методология эконометрического исследования; - теоретическая и эконометрическая модель; - источники данных для анализа; - три типа экономических данных: временные ряды, перекрестные (cross-section) данные, панельные данные; - основные этапы эконометрического анализа данных
2	<p>Базовые понятия статистики.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - генеральная совокупность и выборка; - способы обработки и визуализации данных; - нормальное распределение и связанные с ним Хи-квадрат распределение, распределения Стьюдента и Фишера-Снедекора, их основные свойства; - статистическое оценивание; - точечные оценки; - линейность, несмещенность, эффективность и состоятельность оценок; - свойства выборочных характеристик как точечных оценок; - интервальные оценки, доверительный интервал; - проверка статистических гипотез.
3	<p>Классическая линейная регрессионная модель для случая одной объясняющей переменной.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - теоретическая и выборочная регрессии; - экономическая интерпретация случайной составляющей; - линейность регрессии по переменным и параметрам; - задача оценивания параметров; - метод наименьших квадратов (МНК);

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	<ul style="list-style-type: none"> - система нормальных уравнений и ее решение; - экономическая интерпретация оценок МНК; - дисперсионный анализ; - разложение суммы квадратов отклонений наблюдаемых значений зависимой переменной от ее выборочного среднего; - степень соответствия линии регрессии имеющимся данным; - показатели качества подгонки парной линейной регрессии; - коэффициент детерминации и его свойства; - свойства оценок параметров, полученных по МН; - теорема Гаусса-Маркова для парной регрессии; - предположение о нормальном распределении случайной ошибки в рамках классической линейной регрессии и его следствия; - доверительные интервалы оценок параметров и проверка гипотез об их значимости (t-тест); - проверка гипотез о конкретном значении коэффициентов регрессии; - проверка гипотезы об адекватности уравнения регрессии (F-тест); - приложения регрессионной модели.
4	<p>Классическая модель множественной линейной регрессии</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - множественная линейная регрессия в скалярной и матричной формах; - метод наименьших квадратов; - система нормальных уравнений; - матричное выражение для вектора оценок коэффициентов регрессии; - теорема Гаусса-Маркова для множественной линейной регрессии; - показатели качества подгонки множественной регрессии; - коэффициент множественной корреляции R^2 - коэффициент множественной детерминации и коэффициент множественной детерминации, скорректированный на число степеней свободы; - проверка значимости коэффициентов и адекватности регрессии для множественной линейной регрессионной модели; - доверительные интервалы оценок параметров; - формулировка и проверка общей линейной гипотезы о коэффициентах множественной регрессии; - приложения регрессионной модели.
5	<p>Некоторые вопросы практического использования регрессионных моделей.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - отбор факторов в регрессионную модель; - использование качественных объясняющих переменных; - фиктивные (dummy) переменные в множественной линейной регрессии; - сравнение двух регрессий с помощью фиктивных переменных и теста Чоу (Chow), эквивалентность этих подходов; - выявление нетипичных наблюдений (выбросов); - оценка модели при наличии нетипичных наблюдений.
6	<p>Функциональные преобразования переменных в линейной регрессионной модели.</p> <p>Выбор между моделями.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - влияние изменения масштаба измерения переменных на оценки коэффициентов регрессии и их дисперсий; - регрессия в центрированных и нормированных переменных; - функциональные преобразования переменных в линейной регрессионной модели; - линейная в логарифмах регрессия, как модель с постоянной эластичностью; - модель с постоянными темпами роста (полулогарифмическая модель); - интерпретация оценок коэффициентов различных функциональных форм;

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	<ul style="list-style-type: none"> - выбор между моделям; - тесты Бера и МакАлера, МакКиннона, Уайта и Дэвидсона.
7	<p>Типы ошибок спецификации модели.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - пропущенные и излишние переменные; - неправильная функциональная форма модели; - смещение в оценках коэффициентов, вызываемое невключением существенных переменных; - ухудшение точности оценок (увеличение оценок дисперсий) при включении в модель излишних переменных; - проверка гипотезы о группе излишних переменных; - RESET тест Рамсея (Ramsey's RESET test) для проверки гипотезы о существовании пропущенных переменных.
8	<p>Нарушение предпосылок классической линейной модели. Мультиколлинеарность.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - мультиколлинеарность данных; - идеальная и практическая мультиколлинеарность (квазимультиколлинеарность); - теоретические последствия мультиколлинеарности для оценок параметров регрессионной модели; - нестабильность оценок параметров регрессии и их дисперсий при малых изменениях исходных данных в случае мультиколлинеарности; - признаки наличия мультиколлинеарности; - показатели степени мультиколлинеарности; - вспомогательные регрессии и показатель "вздутия" дисперсии (VIF); - индекс обусловленности информационной матрицы (CI) как показатель степени мультиколлинеарности; - методы борьбы с мультиколлинеарностью: методы пошагового включения и пошагового исключения переменных, их достоинства и недостатки; - тест Фаррера-Глоубера.
9	<p>Нарушение предпосылок классической линейной модели. Гетероскедастичность.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - нарушение гипотезы о гомоскедастичности ошибок регрессии; - последствия гетероскедастичности для оценок коэффициентов регрессии методом наименьших квадратов и проверки статистических гипотез; - тесты на выявление гетероскедастичности; - оценивание при наличии гетероскедастичности; - взвешенный метод наименьших квадратов; - обобщенный метод наименьших квадратов; - робастные стандартные ошибки оценок коэффициентов регрессии в форме Уайта (White).
10	<p>Нарушение предпосылок классической линейной модели. Автокорреляция.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - определение; - способы обнаружения; - тест Дарбина-Уотсона; - последствия автокорреляции; - возможности устранения автокорреляции; - стохастические объясняющие переменные; - коррелированность со случайным фактором; - метод инструментальных переменных.
11	<p>Модели временных рядов.</p> <p>Рассматриваемые вопросы:</p> <ul style="list-style-type: none"> - способы декомпозиции ряда на составляющие: тренд, сезонность, ошибка; - декомпозиция ряда с помощью модели ETS (error, trend, seasonal);

№ п/п	Тематика лекционных занятий / краткое содержание
	<ul style="list-style-type: none"> - прогнозирование с помощью ETS моделей; - стационарные и нестационарные временные ряды; - модель случайного блуждания; - тест Дикки-Фуллера; - тест KPSS.

4.2. Занятия семинарского типа.

Практические занятия

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
1	<p>Способы представления и обработки статистических данных. Точечные и интервальные оценки.</p> <p>В результате работы на практическом занятии студент получает умения рассчитывать точечные интервальные оценки на основе собранных данных</p>
2	<p>Статистические выводы: оценки и проверки гипотез. Гипотезы о среднем, о дисперсии. Гипотезы о равенстве дисперсий, о равенстве математических ожиданий.</p> <p>В результате работы на практическом занятии студент учится формулировать статистические гипотезы, усваивает правила их проверки, отрабатывает навыки проверки ключевых гипотез о параметрах распределения.</p>
3	<p>Коэффициент парной корреляции: вычисление, свойства. Оценка тесноты парной линейной корреляционной связи.</p> <p>В результате работы на практическом занятии студент отрабатывает навыки вычисления и проверки свойств коэффициента корреляции как меры тесноты парной линейной корреляционной связи, учится проверять его статистическую значимость.</p>
4	<p>Парная линейная регрессия.</p> <p>В результате работы на практических занятиях студент научится находить оценки МНК-коэффициентов парной регрессии, проверять качество уравнения в целом и его отдельных параметров с использованием критериев Стьюдента и Фишера, проверять статистические гипотезы относительно параметров модели парной линейной регрессии, интерпретировать результаты регрессионного анализа, приобретает навыки оценки парной регрессии в MS Excel и статистическом пакете Gretl, учится применять результаты моделирования к прогнозированию, анализировать степень зависимости одного показателя от другого.</p>
5	<p>Классическая модель множественной линейной регрессии</p> <p>В результате работы на практических занятиях студент осваивает правила и инструменты для построения уравнение множественной линейной регрессии в MS Excel и Gretl, проверять качество уравнения в целом и его отдельных параметров с использованием критериев Стьюдента и Фишера, учится применять результаты моделирования к прогнозированию, анализировать степень зависимости одного показателя от другого, интерпретировать результаты моделирования.</p>
6	<p>Корреляционный анализ зависимостей в эконометрике.</p> <p>В результате работы на практическом занятии студент приобретает навыки построения и анализа матрицы парных корреляций в MS Excel и Gretl для целей отбора факторов в модель, учится интерпретировать значения различных видов коэффициентов корреляции.</p>
7	<p>Некоторые вопросы спецификации модели множественной линейной регрессии.</p> <p>В результате работы на практическом занятии студент исследует различные способы обоснованного отбора факторов в модель, учится исследовать структурную стабильность данных и учитывать это при моделировании с помощью теста Чоу и фиктивных переменных, приобретает навыки выявления нетипичных наблюдений.</p>

№ п/п	Тематика практических занятий/краткое содержание
8	Нелинейные модели в экономике. В результате работы на практическом занятии студент знакомится с различными видами зависимостей в экономике, учится строить их математические модели средствами MS Excel и Gretl, исследовать их качество, приобретает навыки применения результатов моделирования для количественного описания экономических процессов и явлений.
9	Нарушение предпосылок классической линейной модели и их влияние на адекватность результатов моделирования На практических занятиях студент учится обнаруживать, избегать и устранять основные нарушения предпосылок теоремы Гаусса-Маркова с использованием различных статистических тестов.
10	Модели временных рядов В результате работы на практическом занятии студент учится выявлять и моделировать различные компоненты временного ряда, приобретает навыки построения, моделирования, анализа и прогнозирования временных рядов в целом средствами MS Excel и Gretl.

4.3. Самостоятельная работа обучающихся.

№ п/п	Вид самостоятельной работы
1	Подготовка к практическим занятиям
2	Работа с лекционным материалом
3	Работа с литературой
4	Выполнение курсовой работы.
5	Подготовка к промежуточной аттестации.
6	Подготовка к текущему контролю.

4.4. Примерный перечень тем курсовых работ

- 1) Исследование пространственных эконометрических моделей
- 2) Анализ и прогнозирование доходов населения
- 3) Анализ и прогнозирование объема контейнерных перевозок
- 4) Анализ социально-экономических показателей регионов России
- 5) Эконометрический анализ функции спроса и спроса-предложения на основные виды продовольственных товаров
- 6) Комплексный анализ взаимосвязи финансово-экономических показателей деятельности предприятий
- 7) Комплексный анализ факторов текучести кадров
- 8) Комплексный анализ взаимосвязи финансово-экономических показателей деятельности организаций транспорта
- 9) Комплексный анализ показателей качества перевозок железнодорожным транспортом

10) Эконометрическое моделирование рынка жилья

В течение семестра студент выполняет курсовую работу по согласованной с преподавателем теме.

Курсовая работа состоит из кейс-заданий, исходные данные для которых каждому студенту выдаются в соответствии с индивидуальным вариантом.

5. Перечень изданий, которые рекомендуется использовать при освоении дисциплины (модуля).

№ п/п	Библиографическое описание	Место доступа
1	Эконометрика : учебник для вузов / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0.	https://urait.ru/bcode/488603 (дата обращения: 02.02.2022).— Текст : электронный
2	Демидова, О. А. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / О. А. Демидова, Д. И. Малахов. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 334 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00625-4.	https://urait.ru/bcode/489325 (дата обращения: 02.02.2022).— Текст : электронный
3	Кремер, Н. Ш. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; под редакцией Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 308 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08710-9.	https://urait.ru/bcode/488678 (дата обращения: 02.02.2022).— Текст : электронный
4	Анализ данных : учебник для вузов / В. С. Мхитарян [и др.] ; под редакцией В. С. Мхитаряна. — Москва : Издательство Юрайт, 2022. — 490 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00616-2.	https://urait.ru/bcode/489100 (дата обращения: 02.02.2022).— Текст : электронный
5	Ишханян М.В. Введение в эконометрику: Учебное пособие. – М.: МГУПС (МИИТ), 2016. – 117 с.	НТБ РУТ(МИИТ): http://library.miit.ru/
6	Ишханян М.В., Карпенко Н.В. Эконометрика. Часть 1. Парная регрессия: Учебное пособие. – М.: МГУПС (МИИТ), 2016. – 117 с.	НТБ РУТ(МИИТ): http://library.miit.ru/
7	Ишханян М.В. Эконометрика: Учебное пособие. – М.: РУТ(МИИТ), 2017. – 65с.	https://rut-miit.ru/
8	Карпенко Н.В. Прикладная эконометрика. Оценка стоимости квартиры на рынке жилья: Учебное пособие. - М.: РУТ (МИИТ), 2018. - 111 с	https://rut-miit.ru/

6. Перечень современных профессиональных баз данных и информационных справочных систем, которые могут использоваться при освоении дисциплины (модуля).

Научно-техническая библиотека РУТ (МИИТ): <http://library.miit.ru>
Федеральная служба государственной статистики: <https://www.gks.ru>
Официальный сайт Международного валютного фонда:
<https://www.imf.org/>
Официальный сайт Банка России: <https://www.cbr.ru/>
Финансовый портал «Финам.ру»: <https://www.finam.ru/>

7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства, необходимого для освоения дисциплины (модуля).

Офисный пакет приложений Microsoft Office
Прикладной программный пакет Gretl

8. Описание материально-технической базы, необходимой для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю).

Для проведения лекционных занятий необходима аудитория с мультимедиа аппаратурой. Для проведения практических занятий требуется аудитория, оснащенная мультимедиа аппаратурой и ПК с необходимым программным обеспечением и подключением к сети интернет.

9. Форма промежуточной аттестации:

Зачет в 3 семестре.

Курсовая работа в 4 семестре.

Экзамен в 4 семестре.

10. Оценочные материалы.

Оценочные материалы, применяемые при проведении промежуточной аттестации, разрабатываются в соответствии с локальным нормативным актом РУТ (МИИТ).

Авторы

Доцент, к.н. кафедры
«Информационные системы
цифровой экономики»

Ишханян Маргарита
Владимировна

Доцент, к.н. кафедры
«Информационные системы
цифровой экономики»

Фроловичев
Александр Иванович

Лист согласования

Заведующий кафедрой МФиУУ

Е.З. Макеева

Заведующий кафедрой ИСЦЭ

Л.А. Каргина

Председатель учебно-методической
комиссии

М.В. Ишханян