

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
«Национальный исследовательский университет «МЭИ»

Направление подготовки/специальность: 38.03.02 Менеджмент

Наименование образовательной программы: Логистические системы в экономике и управлении

Уровень образования: высшее образование - бакалавриат

Форма обучения: Очно-заочная

Рабочая программа дисциплины
ЭКОНОМЕТРИКА

Блок:	Блок 1 «Дисциплины (модули)»
Часть образовательной программы:	Вариативная
№ дисциплины по учебному плану:	Б1.В.11.02.02
Трудоемкость в зачетных единицах:	7 семестр - 4;
Часов (всего) по учебному плану:	144 часа
Лекции	7 семестр - 12 часов;
Практические занятия	7 семестр - 16 часов;
Лабораторные работы	не предусмотрено учебным планом
Консультации	проводится в рамках часов аудиторных занятий
Самостоятельная работа	7 семестр - 115,7 часов;
в том числе на КП/КР	не предусмотрено учебным планом
Иная контактная работа	проводится в рамках часов аудиторных занятий
включая:	
Проверочная работа	
Промежуточная аттестация:	
Зачет с оценкой	7 семестр - 0,3 часа;

Москва 2019

ПРОГРАММУ СОСТАВИЛ:

Преподаватель

(должность)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Сотниченко Е.
	Идентификатор	R4dba8757-SotnichenkoY-c3f9793

(подпись)

Е. Сотниченко

(расшифровка подписи)

СОГЛАСОВАНО:

Руководитель
образовательной программы

(должность, ученая степень, ученое звание)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Епифанов В.А.
	Идентификатор	Rad930396-YerifanovVA-60810d9

(подпись)

В.А. Епифанов

(расшифровка
подписи)

Заведующий выпускающей
кафедры

(должность, ученая степень, ученое звание)

	Подписано электронной подписью ФГБОУ ВО «НИУ «МЭИ»	
	Сведения о владельце ЦЭП МЭИ	
	Владелец	Кетоева Н.Л.
	Идентификатор	R56dba1ba-KetoyevaNL-5403d8c3

(подпись)

Н.Л. Кетоева

(расшифровка
подписи)

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Цель освоения дисциплины: заключается в приобретении опыта построения эконометрических моделей и определении возможностей их использования для описания, анализа и прогнозирования реальных экономических процессов

Задачи дисциплины

- развитие у студентов способностей, связанных с принятием управленческих решений на основании эконометрических расчетов;
- анализ оценки действий, направленных на достижение и повышение экономической эффективности при различных вариантах осуществления экономических процессов;
- выполнение прогнозных расчетов при принятии решений в зависимости от экономической конъюнктуры.

Формируемые у обучающегося **компетенции** и запланированные **результаты обучения** по дисциплине, соотнесенные с **индикаторами достижения компетенций**:

Код и наименование компетенции	Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения
ПК-7 владением навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов, умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ		знать: - этапы контроля реализации бизнес-планов; - этапы контроля условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов. уметь: - производить контроль реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов; - координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ ВО

Дисциплина относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока дисциплин основной профессиональной образовательной программе Логистические системы в экономике и управлении (далее – ОПОП), направления подготовки 38.03.02 Менеджмент, уровень образования: высшее образование - бакалавриат.

Базируется на уровне среднего общего образования.

Результаты обучения, полученные при освоении дисциплины, необходимы при выполнении выпускной квалификационной работы.

3. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

3.1 Структура дисциплины

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетных единицы, 144 часа.

№ п/п	Разделы/темы дисциплины/формы промежуточной аттестации	Всего часов на раздел	Семестр	Распределение трудоемкости раздела (в часах) по видам учебной работы										Содержание самостоятельной работы/ методические указания	
				Контактная работа							СР				
				Лек	Лаб	Пр	Консультация		ИКР		ПА	Работа в семестре	Подготовка к аттестации /контроль		
КПР	ГК	ИККП	ТК												
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	
1	Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция	42	7	4	-	4	-	-	-	-	-	34	-	<p><u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция"</p> <p><u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция"</p> <p><u>Изучение материалов литературных источников:</u> [2], 163-188</p>	
1.1	Предмет и задачи курса	21		2	-	2	-	-	-	-	-	17	-		
1.2	Парная регрессия и корреляция	21		2	-	2	-	-	-	-	-	17	-		
2	Множественная регрессия и корреляция	21		2	-	4	-	-	-	-	-	15	-		<p><u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Множественная регрессия и корреляция"</p> <p><u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Множественная регрессия и корреляция"</p> <p><u>Изучение материалов литературных источников:</u> [2], 210-241</p>
2.1	Множественная регрессия и корреляция	21		2	-	4	-	-	-	-	-	15	-		
3	Спецификация переменных в уравнениях регрессии	21		2	-	4	-	-	-	-	-	15	-		<p><u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Спецификация переменных в уравнениях регрессии"</p> <p><u>Подготовка к текущему контролю:</u></p>
3.1	Спецификация переменных в уравнениях регрессии	21	2	-	4	-	-	-	-	-	15	-			

														Повторение материала по разделу "Спецификация переменных в уравнениях регрессии" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 478-503
4	Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений	42	4	-	4	-	-	-	-	-	34	-	<u>Подготовка к текущему контролю:</u> Повторение материала по разделу "Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений" <u>Самостоятельное изучение теоретического материала:</u> Изучение дополнительного материала по разделу "Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений" <u>Изучение материалов литературных источников:</u> [1], 629-645	
4.1	Временные ряды в эконометрических исследованиях	21	2	-	2	-	-	-	-	-	17	-		
4.2	Системы эконометрических уравнений	21	2	-	2	-	-	-	-	-	17	-		
	Зачет с оценкой	18.0	-	-	-	-	-	-	-	0.3	-	17.7		
	Всего за семестр	144.0	12	-	16	-	-	-	-	0.3	98	17.7		
	Итого за семестр	144.0	12	-	16	-	-	-	-	0.3	115.7			

Примечание: Лек – лекции; Лаб – лабораторные работы; Пр – практические занятия; КПр – аудиторные консультации по курсовым проектам/работам; ИККП – индивидуальные консультации по курсовым проектам/работам; ГК- групповые консультации по разделам дисциплины; СР – самостоятельная работа студента; ИКР – иная контактная работа; ТК – текущий контроль; ПА – промежуточная аттестация

3.2 Краткое содержание разделов

1. Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция

1.1. Предмет и задачи курса

Определение эконометрики. Эконометрика и экономическая теория. Эконометрика и статистика. Эконометрика и экономико-математические методы. Области применения эконометрических моделей. Методологические вопросы построения эконометрических моделей: обзор используемых методов.

1.2. Парная регрессия и корреляция

Понятие о функциональной, статистической и корреляционной связях. Основные задачи прикладного корреляционно-регрессионного анализа. Уравнение регрессии, его смысл и назначение. Выбор типа математической функции при построении уравнения регрессии. Парная регрессия. Метод наименьших квадратов и условия его применения для определения параметров уравнения парной регрессии. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация. Оценка степени тесноты связи между количественными переменными. Коэффициент ковариации. Показатели корреляции: линейный коэффициент корреляции, индекс корреляции, теоретическое корреляционное отношение. Коэффициент детерминации. Стандартная ошибка уравнения регрессии. Оценка статистической значимости показателей корреляции, параметров уравнения регрессии, уравнения регрессии в целом: t-критерий Стьюдента, F-критерий Фишера.

2. Множественная регрессия и корреляция

2.1. Множественная регрессия и корреляция

Понятие о множественной регрессии. Классическая линейная модель множественной регрессии (КЛММР). Определение параметров уравнения множественной регрессии методом наименьших квадратов. Стандартизованные коэффициенты регрессии, их интерпретация. Парные и частные коэффициенты корреляции. Множественный коэффициент корреляции и множественный коэффициент детерминации. Оценка надежности показателей корреляции. Оценка качества модели множественной регрессии: F-критерий Фишера, t-критерий Стьюдента. Мультиколлинеарность. Методы устранения мультиколлинеарности.

3. Спецификация переменных в уравнениях регрессии

3.1. Спецификация переменных в уравнениях регрессии

Эконометрические модели: общая характеристика, различия статистического и эконометрического подхода к моделированию. Спецификация переменных в уравнениях регрессии. Ошибки спецификации. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Обобщенный метод наименьших квадратов. Проблема гетероскедастичности. Автокорреляция. Анализ линейной модели множественной регрессии при гетероскедастичности и автокорреляции. Фиктивные переменные: общий случай. Множественные совокупности фиктивных переменных. Фиктивные переменные для коэффициентов наклона. Тест Чоу. Моделирование: влияние отсутствия переменной, которая должна быть включена; влияние включения в модель переменной, которая не должна быть включена. Замещающие переменные.

4. Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений

4.1. Временные ряды в эконометрических исследованиях

Специфика временных рядов как источника данных в эконометрическом моделировании. Аналитическое выравнивание временных рядов. Оценка параметров уравнения тренда. Автокорреляция в остатках, ее измерение и интерпретация. Критерий Дарбина-Уотсона в оценке качества трендового уравнения регрессии. Анализ временных рядов при наличии периодических колебаний: аддитивная и мультипликативная модели. Особенности изучения взаимосвязанных временных рядов. Автокорреляция рядов динамики и методы ее устранения. Метод последовательных разностей. Интерпретация параметров уравнения регрессии, построенного по первым и вторым разностям. Метод отклонения уровней ряда от основной тенденции. Метод включения фактора времени.

4.2. Системы эконометрических уравнений

Виды систем эконометрических уравнений. Независимые системы. Рекурсивные системы. Системы одновременных (совместных) уравнений. Структурная и приведенная формы эконометрической модели. Проблемы идентификации. Косвенный и двухшаговый метод наименьших квадратов, общая схема алгоритма расчетов. Применение эконометрических моделей. Модель Кейнса (статистическая и динамическая формы). Модель Клейна.

3.3. Темы практических занятий

1. Предмет и задачи курса;
2. Парная регрессия и корреляция;
3. Множественная регрессия и корреляция;
4. Спецификация переменных в уравнениях регрессии;
5. Временные ряды в эконометрических исследованиях;
6. Системы эконометрических уравнений.

3.4. Темы лабораторных работ

не предусмотрено

3.5 Консультации

Текущий контроль (ТК)

1. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция"
2. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Множественная регрессия и корреляция"
3. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Спецификация переменных в уравнениях регрессии"
4. Консультации направлены на получение индивидуального задания для выполнения контрольных мероприятий по разделу "Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений"

3.6 Тематика курсовых проектов/курсовых работ

Курсовой проект/ работа не предусмотрены

3.7. Соответствие разделов дисциплины и формируемых в них компетенций

Запланированные результаты обучения по дисциплине (в соответствии с разделом 1)	Коды индикаторов	Номер раздела дисциплины (в соответствии с п.3.1)				Оценочное средство (тип и наименование)
		1	2	3	4	
Знать:						
этапы контроля условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов	ПК-7(Компетенция)		+			Проверочная работа/Множественная регрессия и корреляция
этапы контроля реализации бизнес-планов	ПК-7(Компетенция)	+				Проверочная работа/Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция
Уметь:						
координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ	ПК-7(Компетенция)			+		Проверочная работа/Спецификация переменных в уравнениях регрессии
производить контроль реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов	ПК-7(Компетенция)				+	Проверочная работа/Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений

4. КОМПЕТЕНТНОСТНО-ОРИЕНТИРОВАННЫЕ ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ КОНТРОЛЯ ОСВОЕНИЯ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (ТЕКУЩИЙ КОНТРОЛЬ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНАЯ АТТЕСТАЦИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ)

4.1. Текущий контроль успеваемости

7 семестр

Форма реализации: Письменная работа

1. Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений (Проверочная работа)
2. Множественная регрессия и корреляция (Проверочная работа)
3. Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция (Проверочная работа)
4. Спецификация переменных в уравнениях регрессии (Проверочная работа)

Балльно-рейтинговая структура дисциплины является приложением А.

4.2 Промежуточная аттестация по дисциплине

Зачет с оценкой (Семестр №7)

Оценка выставляется из расчета среднего арифметического значения оценки семестровой составляющей по текущему контролю успеваемости и оценки за промежуточную аттестацию

Примечание: Оценочные материалы по дисциплине приведены в фонде оценочных материалов ОПОП.

5. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

5.1 Печатные и электронные издания:

1. Р. Дэвидсон, Д. Г. Мак-Киннон- "Теория и методы эконометрики", Издательство: "Дело", Москва, 2018 - (937 с.)
<https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=577838;>
2. В. П. Яковлев- "Эконометрика", Издательство: "Дашков и К°", Москва, 2019 - (384 с.)
[https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573359.](https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=573359;)

5.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

1. СДО "Прометей";
2. Office;
3. Windows;
4. Майнд Видеоконференции.

5.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы:

1. ЭБС Лань - <https://e.lanbook.com/>
2. ЭБС "Университетская библиотека онлайн" - http://biblioclub.ru/index.php?page=main_ub_red
3. Научная электронная библиотека - <https://elibrary.ru/>
4. Электронная библиотека МЭИ (ЭБ МЭИ) - <http://elib.mpei.ru/login.php>

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Тип помещения	Номер аудитории, наименование	Оснащение
---------------	-------------------------------	-----------

Учебные аудитории для проведения лекционных занятий и текущего контроля	К-511, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	парта со скамьей, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
	К-520, Аудитория для проведения интерактивных занятий кафедры МЭП	кресло рабочее, парта со скамьей, стол преподавателя, стул, трибуна, вешалка для одежды, доска меловая, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, экран, кондиционер, мел, маркер, стилус
Учебные аудитории для проведения практических занятий, КР и КП	К-526, Компьютерный класс ИВЦ	стол, стул, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер
	К-522, Компьютерный класс ИВЦ	стол, стул, компьютерная сеть с выходом в Интернет, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер, телевизор
Учебные аудитории для проведения промежуточной аттестации	К-526, Компьютерный класс ИВЦ	стол, стул, компьютерная сеть с выходом в Интернет, мультимедийный проектор, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер
	К-522, Компьютерный класс ИВЦ	стол, стул, компьютерная сеть с выходом в Интернет, доска маркерная, компьютер персональный, кондиционер, телевизор
Помещения для самостоятельной работы	НТБ-302, Читальный зал отдела обслуживания учебной литературой	стул, стол письменный, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный
	НТБ-303, Компьютерный читальный зал	стол компьютерный, стул, стол письменный, вешалка для одежды, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный, принтер, кондиционер
	НТБ-304, Читальный зал отдела обслуживания учебной литературой	стул, трибуна, стол письменный, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный
Помещения для консультирования	К-203, Кабинет сотрудников каф. "БИТ"	рабочее место сотрудника, стол для оргтехники, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, стол письменный, компьютерная сеть с выходом в Интернет, колонки звуковые, компьютер персональный, принтер, стенд информационный
	К-519, Кабинет сотрудников	стол для оргтехники, стул, шкаф для документов, шкаф для одежды, стол письменный, тумба, компьютерная сеть с выходом в Интернет, компьютер персональный, принтер, кондиционер
Помещения для	К-521/2, Склад	шкаф, хозяйственный инвентарь, запасные

хранения оборудования и учебного инвентаря	кафедры БИТ	комплектующие для оборудования
---	-------------	--------------------------------

БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СТРУКТУРА ДИСЦИПЛИНЫ

Эконометрика

(название дисциплины)

7 семестр

Перечень контрольных мероприятий текущего контроля успеваемости по дисциплине:

КМ-1 Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция (Проверочная работа)

КМ-2 Множественная регрессия и корреляция (Проверочная работа)

КМ-3 Спецификация переменных в уравнениях регрессии (Проверочная работа)

КМ-4 Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений (Проверочная работа)

Вид промежуточной аттестации – Зачет с оценкой.

Номер раздела	Раздел дисциплины	Индекс КМ:	КМ-1	КМ-2	КМ-3	КМ-4
		Неделя КМ:	4	8	12	14
1	Предмет и задачи курса. Парная регрессия и корреляция					
1.1	Предмет и задачи курса		+			
1.2	Парная регрессия и корреляция		+			
2	Множественная регрессия и корреляция					
2.1	Множественная регрессия и корреляция			+		
3	Спецификация переменных в уравнениях регрессии					
3.1	Спецификация переменных в уравнениях регрессии				+	
4	Временные ряды в эконометрических исследованиях. Системы эконометрических уравнений					
4.1	Временные ряды в эконометрических исследованиях					+
4.2	Системы эконометрических уравнений					+
Вес КМ, %:			25	25	25	25