

**Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ»**

ФАКУЛЬТЕТ ФИНАНСОВ И БАНКОВСКОГО ДЕЛА

(наименование структурного подразделения (института/факультета/филиала))

Кафедра «Фондовые рынки и финансовый инжиниринг»

(наименование кафедры)

УТВЕРЖДЕНА

Кафедрой «Фондовые рынки и
финансовый инжиниринг»

Факультета финансов и банковского
дела

Протокол от «17» сентября 2018 г.

№5

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.Б.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)»

(индекс, наименование дисциплины (модуля), в соответствии с учебным планом)

38.04.01 Экономика

(код, наименование направления подготовки (специальности))

"Финансовая дипломатия"

(направленность(и) (профиль (и)/специализация(ии))

Магистр

(квалификация)

Очная/очно-заочная/заочная

(форма(ы) обучения)

Год набора: 2019

Москва, 2018 г.

Автор–составитель:

к. ф-м.н., доцент, доцент кафедры «Фондовые рынки и финансовый инжиниринг» Чернова М.В.

Заведующий кафедрой

«Фондовые рынки и финансовый инжиниринг» д.э.н., проф. Корищенко К.Н.

СОДЕРЖАНИЕ

| | |
|---|----|
| 1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы..... | 4 |
| 2. Объем и место дисциплины в структуре ОП ВО | 5 |
| 3. Содержание и структура дисциплины | 6 |
| 4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине..... | 11 |
| 5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины | 29 |
| 6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине..... | 30 |
| 6.1. Основная литература..... | 30 |
| 6.2. Дополнительная литература..... | 31 |
| 6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы..... | 31 |
| 6.4. Нормативные правовые документы..... | 31 |
| 6.5. Интернет-ресурсы..... | 31 |
| 6.6. Иные источники..... | 33 |
| 7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы..... | 33 |

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы

1.1. Дисциплина Б1.Б.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» обеспечивает овладение следующими компетенциями:

| Код компетенции | Наименование компетенции | Код этапа освоения компетенции | Наименование этапа освоения компетенции |
|-----------------|--|--------------------------------|--|
| УК ОС-1 | Способность применять критический анализ и системный подход для решения профессиональных задач | УК ОС-1.2 | Способность анализировать и обобщать экономическую и финансовую информацию |
| УК ОС-2 | Способность применять проектный подход при решении профессиональных задач | УК ОС-2.2. | Способность моделировать финансовые ситуации и применять построенные модели при проектировании |

1.2. В результате освоения дисциплины у студентов должны быть сформированы:

| ОТФ/ТФ (при наличии профстандарта) | Код этапа освоения компетенции | Результаты обучения |
|---|-----------------------------------|--|
| <p>ПС «Специалист по финансовому консультированию»</p> <p>ОТФ Консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля (В) (ч.);</p> <p>ОТФ Управление процессом финансового консультирования в организации (подразделении) (С) (ч.);</p> <p>ТФ Финансовое консультирование по широкому спектру финансовых услуг (В/01.7) (ч.);</p> <p>ТФ Разработка</p> | <p>УК ОС-2.2</p> <p>УК ОС-1.2</p> | <p>На уровне знаний:</p> <p>Знать:</p> <p>1. Основные информационные технологии, применяемые в процессе финансового консультирования;</p> <p>2. Бюджет организации на внедрение и поддержание аппаратно-информационного обеспечения процесса финансового консультирования;</p> <p>3. Основные финансовые организации и профессиональные участники банковской системы;</p> <p>4. Основные организации и профессиональные участники рынка ценных бумаг и коллективного инвестирования.</p> |
| | | <p>На уровне умений:</p> <p>Уметь:</p> <p>1. Собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра финансовых (инвестиционных) услуг;</p> |

| | | |
|--|--|---|
| методологии и стандартизация процесса финансового консультирования и финансового планирования(С/01.7) (ч.); ТФ Создание и развитие организационной структуры по финансовому консультированию (С/02.7) (ч.); | | 2. Выступать в качестве эксперта в процессе принятия клиентом важных финансовых (инвестиционных) решений; 3. Анализировать и выносить суждение о применимости методик финансового планирования для отдельных категорий клиентов; На уровне навыков: Владеть навыками: 1. Разрабатывать, формулировать технические задания и управлять проектами аппаратно-информационного обеспечения финансового консультирования; 2. Формировать общую позицию по вопросу финансового консультирования и доносить ее до всех заинтересованных сторон |
|--|--|---|

2. 2. Объем и место дисциплины (модуля) в структуре ОП ВО

Объем дисциплины

Дисциплина Б1.Б.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» составляет 5 зачетных единицы, т.е. 180 академических часов.

Для студентов очной и очно-заочной формы обучения на контактную работу с преподавателем выделено 64 часа, из них 32 часа лекций и 32 часа практических занятий, на самостоятельную работу обучающихся выделено 80 часов. Для студентов заочной формы обучения на контактную работу с преподавателем выделено 22 часа, из них 8 часов лекций и 14 часов практических занятий, на самостоятельную работу обучающихся выделено 152 часа.

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина Б1.Б.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» изучается на 2 курсе, в 3 семестре для студентов очной и очно-заочной формы обучения; студентами заочной формы – на 2 курсе (1 поток), на 2 курсе (2 поток).

Дисциплина Б1.Б.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» реализуется после изучения дисциплин бакалавриата.

Форма промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом – экзамен в устной форме.

3. Содержание и структура дисциплины (модуля)

Очная форма обучения

| № п/п | Наименование тем (разделов) | Объем дисциплины , час. | | | | | | Форма текущего контроля успеваемост и, промежуточ ной аттестации* ** |
|--------------------------|---|-------------------------|--|----|----|---------|-----|--|
| | | Всего | Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий | | | | СРС | |
| | | | Л | ЛР | ПЗ | КС Р | | |
| Тема 1. | Регрессионный анализ и эндогенность | 14 | 4 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 2. | Оценка систем уравнений | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 3. | Модели панельных данных. | 16 | 4 | | 4 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 4. | Нелинейные модели и отбор | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 5. | Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA. | 18 | 4 | | 6 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 6. | Причинность и блочная экзогенность. | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 7. | Методология векторных авторегрессий (VAR). | 16 | 4 | | 4 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 8. | Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана Байесовские VAR. | 16 | 4 | | 4 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 9. | Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 10. | Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни. | 8 | 2 | | 2 | | 4 | ПЗ |
| Тема 11. | Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов. | 8 | 2 | | 2 | | 4 | Д |
| Промежуточная аттестация | | 36 | | | | | | Экз |
| Всего по курсу: | | 180 | 32 | | 32 | | 80 | |

Очно-заочная форма обучения

| № п/п | Наименование тем (разелов) | Объем дисциплины , час. | | | | | | Форма текущего контроля успеваемост и, промежуточ ной аттестации* ** |
|-------------------------|---|-------------------------|--|----|----|---------|-----|--|
| | | Всего | Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий | | | | СРС | |
| | | | Л | ЛР | ПЗ | КС Р | | |
| Тема 1. | Регрессионный анализ и эндогенность | 14 | 4 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 2. | Оценка систем уравнений | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 3. | Модели панельных данных. | 16 | 4 | | 4 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 4. | Нелинейные модели и отбор | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 5. | Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA. | 18 | 4 | | 6 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 6. | Причинность и блочная экзогенность. | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 7. | Методология векторных авторегрессий (VAR). | 16 | 4 | | 4 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 8. | Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана Байесовские VAR. | 16 | 4 | | 4 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 9. | Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью | 12 | 2 | | 2 | | 8 | ПЗ, Д |
| Тема 10. | Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни. | 8 | 2 | | 2 | | 4 | ПЗ |
| Тема 11. | Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов. | 8 | 2 | | 2 | | 4 | Д |
| Промежуточная атестация | | 36 | | | | | | Экз |
| Всего по курсу: | | 180 | 32 | | 32 | | 80 | |

Заочная форма обучения

| № п/п | Наименование тем (разелов) | Объем дисциплины , час. | | | | | | Форма текущего контроля успеваемост и, промежуточ ной аттестации* ** |
|-------------------------|---|-------------------------|--|----|----|---------|-----|--|
| | | Всего | Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий | | | | СРС | |
| | | | Л | ЛР | ПЗ | КС Р | | |
| Тема 1. | Регрессионный анализ и эндогенность | 18 | 2 | | | | 14 | ПЗ, Д |
| Тема 2. | Оценка систем уравнений | 16 | | | 2 | | 14 | ПЗ, Д |
| Тема 3. | Модели панельных данных. | 16 | 2 | | | | 14 | ПЗ, Д |
| Тема 4. | Нелинейные модели и отбор | 16 | | | 2 | | 14 | ПЗ, Д |
| Тема 5. | Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA. | 18 | 2 | | | | 16 | ПЗ, Д |
| Тема 6. | Причинность и блочная экзогенность. | 18 | | | 2 | | 16 | ПЗ, Д |
| Тема 7. | Методология векторных авторегрессий (VAR). | 18 | 2 | | | | 16 | ПЗ, Д |
| Тема 8. | Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана Байесовские VAR. | 18 | | | 2 | | 16 | ПЗ, Д |
| Тема 9. | Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью | 18 | | | 2 | | 16 | ПЗ, Д |
| Тема 10. | Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни. | 12 | | | 2 | | 10 | ПЗ |
| Тема 11. | Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов. | 6 | | | 2 | | 4 | Д |
| Промежуточная атестация | | 6 | | | | | | Экз. |
| Всего по курсу: | | 180 | 8 | | 14 | | 152 | |

Примечание:

** – формы текущего контроля успеваемости: практические задания (ПЗ), доклад (Д).

***форма промежуточной аттестации: экзамен (Экз).

Содержание дисциплины

Тема 1. Регрессионный анализ и эндогенность.

Этапы эмпирического анализа экономических задач. Типы данных. Структурное и неструктурное моделирование. Причинно-следственная связь и принцип *ceteris paribus*. Условное математическое ожидание.

Классическая линейная модель регрессии. Оценка методом наименьших квадратов. Вывод МНК-оценок. Метод моментов – определение и пример. Подобранные значения и остатки. Качество подбора. Коэффициенты регрессии, изменение масштаба. Простейшие способы учета нелинейности. Моменты МНК-оценок, их несмещенность, дисперсия оценок. Оценка дисперсии ошибок.

Модель регрессии с многими объясняющими переменными. МНК-оценки для множественной регрессии. Теорема Гаусса – Маркова. Оценка дисперсии ошибки. Матрица ковариации оценок. Интерпретация коэффициентов.

Оценивание условного ожидания и прогнозирование.

Построение доверительных множеств и проверка гипотез. Распределения МНК-оценок коэффициентов и остаточной суммы квадратов, *t*-статистика. Доверительные интервалы для отдельных коэффициентов, основанные на значениях *t*-статистик. Проверка гипотез: критическое множество и уровень значимости статистического критерия, мощность критерия при простой альтернативе. Проверка гипотез о значениях коэффициентов с использованием *t*-статистики. Наблюдаемый уровень значимости (*P*-значение).

Случайные регрессоры. Асимптотические свойства МНК-оценок. Состоятельность. Тестирование гипотез с использованием асимптотических свойств.

Тестирование произвольных ограничений на коэффициенты. *F*-статистика.

Проблемы множественной регрессионной модели. Выбор функциональной формы. Ошибки спецификации. Тестирование на ошибки спецификации. Коррелированные регрессоры. Проблема мультиколлинеарности. Пропущенные переменные. Смещение оценок. Прокси-переменные. Бинарные и дискретные объясняющие переменные. Сгенерированные регрессоры. Переменные, измеренные с ошибкой. Неслучайная выборка и пропущенные наблюдения.

Проблема гетероскедастичности. Тестирование гипотез при наличии гетероскедастичности. Тестирование на присутствие гетероскедастичности. Обобщенный МНК. Доступный ОМНК.

Эндогенность. Источники эндогенности. Смещение в МНК-оценках из-за эндогенности. Инструментальные переменные. Требования к инструментальным переменным. 2-ступенчатый МНК. Состоятельность, асимптотическая нормальность и эффективность. Тестирование гипотез. Тестирование гипотез в присутствии гетероскедастичности. Проблемы 2-ступенчатого МНК. Слабые инструменты. Тесты на эндогенность. Тест условий сверхидентификации.

Тема 2. Оценка систем уравнений.

МНК для систем уравнений. Экзогенность объясняющих переменных. Строгая экзогенность. Примеры систем: внешне не связанные уравнения (SUR), панельные данные. Вид матрицы ковариации ошибок. Оценка объединенным МНК. Оценка ОМНК и доступным ОМНК. Асимптотические свойства. Тестирование гипотез. Оценка внешне не связанных уравнений с ограничениями на параметры.

Оценка систем уравнений с помощью инструментальных переменных. 2-ступенчатый МНК для систем уравнений. 3-ступенчатый МНК. Обобщенный метод моментов. Матрицы весов. Оптимальная матрица весов. Выбор метода оценки систем. Тестирование гипотез.

Системы одновременных уравнений. Экономические задачи, приводящие к системам одновременных уравнений. Идентификация. Условия исключения. Сокращенная форма. Линейные ограничения общего вида. Условия идентификации, отсутствия идентификации, точной идентификации и сверхидентификации. Эффективная оценка параметров сокращенной формы. Идентификация на основе произвольных ограничений между уравнениями. Идентификация на основе ограничений на матрицу ковариации. Нелинейность по эндогенным переменным.

Тема 3. Модели панельных данных.

Мотивация: проблема пропущенных переменных. Фиксированные эффекты, случайные эффекты. Предположения об ошибках: строгая экзогенность объясняющих переменных, поперечная экзогенность. Оценки уравнения в разностях. Оценки панелей со случайными эффектами. Оценки панелей с фиксированными эффектами. Тест Хаусмана. Кластеризация наблюдений.

Тема 4. Нелинейность и отбор

Дискретные зависимые переменные. Линейная модель вероятности. Пробит-модель. Логистическая модель. Оценка методом максимального правдоподобия. Эндогенность в объясняющих переменных. Множественная логистическая модель. Упорядоченные логистические и пробит-модели.

Цензурированные регрессии и неслучайные выборки. Тобит-модели. Гетерогенность и эндогенность в тобит-моделях. Селективная выборка. тестирование и коррекция смещения селективной выборки

Оценка программ и экспериментов. Проблема дизайна экспериментов и самоотбор. Методы оценки с использованием propensity score. Методы оценки с использованием инструментальных переменных.

Тема 5. Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA.

Сглаживание временного ряда. Прогнозирование будущих значений временного ряда. Скользящие средние. Фильтр Ходрика – Прескотта. Простое экспоненциальное сглаживание. Двойное экспоненциальное сглаживание, метод Брауна. Метод Хольта. Метод Хольта – Винтерса. Фильтр Бакстера – Кинга. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA.

Тема 6. Причинность и блочная экзогенность.

Понятия причинности по Грейнджеру и блочной экзогенности одной группы переменных относительно другой группы переменных.

Тема 7. Методология векторных авторегрессий (VAR).

Методология VAR и ее инструментарий (функции импульсного отклика и декомпозиции дисперсий ошибок прогнозов). Примеры использования методологии VAR для конкретных статистических данных, возникающие при этом затруднения.

Тема 8. Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана. Байесовские VAR.

Суть байесовского подхода, его отличие от частотного (классического) подхода. Переход от априорного распределения к апостериорному. Сопряженные распределения. Байесовские точечные оценки. Байесовские доверительные интервалы. Байесовская проверка гипотез. Байесовские выводы в модели нормальной линейной регрессии.

Методы получения выборок из апостериорного распределения. Сэмплирование по Гиббсу. Алгоритм Метрополиса. Алгоритм Метрополиса – Гастингса.

Байесовский подход в моделях пространства состояний. Фильтр Калмана. Конструкция алгоритма. Фильтрация и сглаживание. Структурные модели временных рядов.

Байесовские VAR. Априорное распределение Миннесоты/Литтермана.

Тема 9. Нелинейные модели временных рядов.

Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью; мотивация к их использованию. Модель ARCH, ее недостатки. Тестирование на ARCH-эффект. Модели AR/ARCH. Стандартизованные остатки. Обобщенная ARCH модель (GARCH), ее преимущества и недостатки. Тестирование на GARCH эффект. Модели AR/GARCH. Модель IGARCH. Модели с эффектом рычага: EGARCH, TARARCH.

Кривая влияния новостей. Проверка гипотезы об отсутствии асимметрии влияния плохих и хороших новостей. Компонентная GARCH. Модель GARCH-in-Mean. Многомерные модели GARCH.

Тема 10. Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни.

Дробно-интегрированные временные ряды. Модель ARFIMA.

Проверка гипотезы единичного корня и нелинейные преобразования временных рядов. Выбор между проверкой наличия единичного корня в уровнях и проверкой наличия единичного корня в логарифмах уровней.

Мотивация к рассмотрению моделей с сезонными единичными корнями. Проверка гипотез о наличии у временного ряда сезонных единичных корней.

Тема 11. Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов.

Методы оценивания долговременной связи между нестационарными временными рядами. Оценивание в треугольной модели. Оценивание ранга коинтеграции методом Йохансена. Динамический метод наименьших квадратов. Динамический метод наименьших квадратов для коинтегрированных рядов первого порядка интегрированности. Динамический метод наименьших квадратов для системы коинтегрированных рядов, содержащей ряды первого и второго порядков интегрированности.

4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и фонд оценочных средств промежуточной аттестации по дисциплине

4.1. Текущий контроль успеваемости

4.1.1. Формы текущего контроля успеваемости

| Тема (раздел) | | Методы текущего контроля успеваемости |
|---------------|---|---------------------------------------|
| Тема 1. | Регрессионный анализ и эндогенность | Практические задания. Доклад. |
| Тема 2. | Оценка систем уравнений | Практические задания. Доклад. |
| Тема 3. | Модели панельных данных. | Практические задания. Доклад. |
| Тема 4. | Нелинейные модели и отбор | Практические задания. Доклад. |
| Тема 5. | Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA. | Практические задания. Доклад. |
| Тема 6. | Причинность и блочная экзогенность. | Практические задания. Доклад. |
| Тема 7. | Методология векторных авторегрессий (VAR). | Практические задания. Доклад. |
| Тема 8. | Байесовский подход. Введение в фильтр Калмана Байесовские VAR. | Практические задания. Доклад. |
| Тема 9. | Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью | Практические задания. Доклад. |
| Тема 10. | Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни. | Практические задания. |
| Тема 11. | Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов. | Доклад. |

4.1.2. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся.

Типовые оценочные материалы по теме 1. «Регрессионный анализ и эндогенность»

Вариант практического задания:

Используя пакет Eviews, выполнить необходимую корректировку модели, оцененной по статистическим данным о количестве сотрудников на 27 предприятиях (i – номер предприятия, X – численность персонала, Y – количество руководителей) [2]:

| i | X | Y | i | X | Y | i | X | Y |
|---|-----|----|----|------|-----|----|------|-----|
| 1 | 394 | 40 | 10 | 797 | 88 | 19 | 800 | 116 |
| 2 | 347 | 42 | 11 | 788 | 90 | 20 | 950 | 138 |
| 3 | 367 | 47 | 12 | 730 | 94 | 21 | 1080 | 140 |
| 4 | 458 | 54 | 13 | 809 | 98 | 22 | 1125 | 170 |
| 5 | 523 | 57 | 14 | 727 | 107 | 23 | 1121 | 107 |
| 6 | 411 | 59 | 15 | 715 | 110 | 24 | 1300 | 190 |
| 7 | 550 | 66 | 16 | 1099 | 119 | 25 | 1350 | 122 |
| 8 | 634 | 72 | 17 | 1122 | 124 | 26 | 1600 | 310 |
| 9 | 538 | 78 | 18 | 1115 | 127 | 27 | 1750 | 145 |

Выполнить оценивание модели регрессии Y на константу и X , сформировать ряд остатков. Ориентируясь на график зависимости остатков от X и другие графики, а также используя критерии Бройша—Пагана и Глейзера, подобрать подходящую форму зависимости дисперсии ошибок от X . Сравнить качество моделей с одинаковой левой частью, используя критерий Шварца. Записать преобразованное уравнение, в котором гетероскедастичность не должна наблюдаться вовсе или быть достаточно слабо выраженной. Оценить это уравнение. Протестировать оцененную модель.

Оценить модель регрессии Y на константу и X , используя встроенную в Eviews процедуру взвешенного метода наименьших квадратов (WLS). В соответствующем окне указать весовую функцию (с которой взвешиваются отклонения). Сравнить оценки коэффициентов с оценками, полученными при непосредственном оценивании преобразованного уравнения.

Обратить внимание на особенности протокола оценивания WLS (взвешенные и невзвешенные статистики). Сравнить значения R^2 для взвешенных и для невзвешенных статистик и определить какое из двух значений больше.

Рассмотреть возможность использования *log-level* модели. Оценить такую модель, провести диагностику остатков. При необходимости расширьте спецификацию правой части уравнения. Убедиться в оправданности такого расширения.

Темы докладов:

1. Метод наименьших квадратов.
2. Моделирование структурного сдвига.
3. Обобщенный метод наименьших квадратов.
4. Доступный обобщенный метод наименьших квадратов.
5. Взвешенный метод наименьших квадратов

Типовые оценочные материалы по теме 2.

Вариант практического задания:

Вариант 1. Применение доступного обобщенного метода наименьших квадратов

Сгенерировать данные, порождаемые моделью

$$DGP: y_i = 12 + 3x_i + 2\varepsilon_i, \quad x_i = 12 * @rnd, \\ \varepsilon_1 = 0, \quad \varepsilon_i = 0,7\varepsilon_{i-1} + v_i, \quad v_i \rightarrow i.i.d.N(0,1), \quad i = 1, \dots, 100$$

Используя сгенерированные данные как статистические данные, провести OLS оценивание статистической модели $y_i = \alpha + \beta x_i + \varepsilon_i$, выполнить диагностику подобранной модели.

Произвести необходимую коррекцию статистических выводов относительно значений коэффициентов. Сравнить полученные статистические выводы в отношении коэффициента β при использовании OLS оценки, оценки Ньюи – Веста, оценки, получаемой в Eviews с AR(1) составляющей, оценки Прайса-Уинстена и оценки Кохрейна - Оркатта.

4. Сравнить (если можно) соответствующие оцененные модели между собой, используя информационные критерии.

Темы докладов:

1. Оценка методом инструментальных переменных.
2. Двухшаговый метод наименьших квадратов.
3. Тесты на спецификацию модели.

Типовые оценочные материалы по теме 3.

Вариант практического задания:

Проанализировать модель:

$$\begin{cases} P_t = aS_t + bX_t + \varepsilon_{t1} \\ S_t = cS_{t-1} + \varepsilon_{t2} \end{cases},$$

$$\begin{pmatrix} \varepsilon_{t1} \\ \varepsilon_{t2} \end{pmatrix} \sim i.i.d. N(0, \Sigma), \quad \Sigma = \begin{pmatrix} \sigma_1^2 & \sigma_{12} \\ \sigma_{12} & \sigma_2^2 \end{pmatrix},$$

где P_t - объем производства некоторого товара;

S_t - объем продаж этого товара;

X_t - некоторая переменная, важная для принятия решений об объемах производства, экзогенная по отношению к рассматриваемой системе одновременных уравнений.

Определить, как характеризуется каждое из двух уравнений: недоидентифицировано, точно идентифицируемо, сверхидентифицируемо.

Оценить коэффициенты структурной формы и проверить гипотезу $H_0 : b = 0$.

Оценить, как влияет решение, принятое на основании этой проверки на идентифицируемость модели и как характеризуется каждое из двух уравнений новой системы.

Предположить, что переменная X_t связана с переменными P_t и S_t тождеством $X_t - X_{t-1} = P_t - S_t$, так что переменную X_t можно рассматривать как инвентарные запасы товара, а $X_t - X_{t-1}$ - как изменение запасов по сравнению с предыдущим периодом.

Как влияет эта информация на выводы относительно идентифицируемости модели и процедуры оценивания [2].

Темы докладов:

1. Трехступенчатый метод наименьших квадратов.
2. Нелинейные системы уравнений.
3. Системы уравнений спроса: вырожденные системы.

Типовые оценочные материалы по теме 4.

Вариант практического задания:

На сайте <http://pages.stern.nyu.edu/~wgreene/Econometrics/PanelDataSets.htm> в файле Spanish Dairy Farm Production содержатся данные о производстве молока на 247 фермах Испании за период с 1993 по 1998 г. [2].

Переменные:

FARM – идентификатор фермы;

YEAR – год 93, 94, ..., 98.

Объясняющие переменные:

COWS – количество коров, x_1 – отклонения $\ln(\text{COWS})$ от его среднего по всем фермам;

LAND – земельные угодья, LABOR – затраты труда,

FEED – корм, x_{11} , x_{22} , x_{33} , x_{44} , x_{12} , x_{13} , x_{14} , x_{23} , x_{24} , x_{34} – квадраты и произведения переменных x_1 , x_2 , x_3 , x_4 ;

YEAR93, ..., YEAR98 – дамми-переменные.

Объясняемые переменные:

MILK – объем производства молока на ферме;

YIT = $\ln(\text{MILK})$.

Используя эти данные, оценить различные модели с целью выяснения влияния указанных факторов на объем производства молока на ферме.

Темы докладов:

1. Гетероскедастичность в модели со случайными эффектами.
2. Автокорреляция в моделях панельных данных.
3. Состоятельная и эффективная оценка динамических моделей панельных данных.

Типовые оценочные материалы по теме 5.

Вариант практического задания: Используя пакет Eviews сгенерировать данные о среднедушевом месячном доходе семьи (x) и количестве автомобилей (y), имеющихся у семьи [2].

Подобрать подходящую порядковую пробит-модель, объясняющую количество автомобилей в семье величиной среднедушевого месячного дохода семьи.

Проанализировать прогнозные качества подобранной модели. Сравнить их с качеством прогнозов по тривиальной модели, не учитывающей влияние доходов семьи.

Использовать процесс порождения данных:

$$y_i^* = x_i + \varepsilon_i, \quad i = 1, \dots, 1000,$$

где x_1, \dots, x_{1000} - независимые, одинаково распределенные случайные величины, имеющие равномерное распределение в интервале $(100; 2100)$; ε_i - независимые в совокупности (и независимые от x_i) случайные величины, имеющие одинаковое нормальное распределение $\varepsilon_i \sim N(0, 300^2)$, $\sigma = 300$. Принять

$$K = 3, \quad \gamma_1 = 1100, \quad \gamma_2 = 1850.$$

В объекте *Equation* в качестве метода оценивания выбрать *ORDERED – Ordered Choice*, в качестве распределения ошибок *Normal*.

Рассмотреть таблицу, получаемую как *View → Prediction Evaluation*.

Темы докладов:

1. Модели со случайными эффектами.
2. Модели с фиксированными эффектами.
3. Динамические модели бинарного выбора.
4. Полупараметрическая модель.
5. Двумерные пробит-модели.

Типовые оценочные материалы по теме 6.

Вариант практического задания:

Провести исследование для ряда значений индекса ММББ (ряд IND). Данные для этого примера содержатся на сайте <http://www.micex.ru/marketdata/indices/data/archive> [2].

Для построения трехпериодного скользящего среднего в пакете Eviews можно использовать цепочку Objects → New object → Model → sma_3=(ind(-1) +ind +ind (+1))/3 или воспользоваться встроенной функцией

@movav: Genr → sma_3 = @movav(ind(1),3). Значение (ind(1),3) указывает на то что усредняются текущее и 2 предыдущих значения ряда ind(1), то есть текущее и по одному соседнему (до и после) значению самого ряда *ind*.

Для построения пятипериодного скользящего среднего можно использовать цепочку Objects → New object → Model → sma_5=(ind(-2)+ind(-1)+ind+ind(+1)+ind(+2))/5 или воспользоваться встроенной функцией

@movav: Genr → sma_5 = @movav(ind(2),5).

Значение (ind(2),5) указывает на то что усредняются текущее и 4 предыдущих значения ряда ind(2), то есть текущее и по два соседнему (до и после) значению самого ряда *ind*.

Темы докладов:

1. Фильтр Ходрика-Прескотта.
2. Метод Брауна.
3. Метод Хольта.
4. Метод Хольта-Винтерса.
5. Фильтр Бакстера-Кинга.

Типовые оценочные материалы по теме 7.

Вариант практического задания:

Рассмотреть следующую модель VAR(1) для трех рядов [2]:

$$\begin{aligned} Y_t &= 0,6Y_{t-1} + 0,5Z_{t-1} + \varepsilon_{1t}, \\ X_t &= 0,6Y_{t-1} + 0,25Z_{t-1} + \varepsilon_{2t}, \\ Z_t &= 0,25X_{t-1} + 0,6Z_{t-1} + \varepsilon_{3t}. \end{aligned}$$

Выяснить: выполнено ли для этой модели условие стабильности; является ли переменная X G-причиной для переменной Y.

Построить реализацию указанной модели, полагая $Y_1 = X_1 = Z_1 = 0$ и генерируя $\varepsilon_{1t}, \varepsilon_{2t}, \varepsilon_{3t}$ как независимые между собой процессы гауссовского белого шума с $D(\varepsilon_{1t}) = \dots = D(\varepsilon_{3t}) = 1$. Для каждой пары переменных проверить гипотезу о том, что одна из переменных не является G-причиной для второй переменной.

Матричный полином $A(L)$ имеет здесь вид:

$$A(L) = I_3 - \Pi_1 L = \begin{pmatrix} 1 & 0 & 0 \\ 0 & 1 & 0 \\ 0 & 0 & 1 \end{pmatrix} - \begin{pmatrix} 0,6L & 0 & 0,5L \\ 0 & 0,6L & 0,25L \\ 0 & 0,25L & 0,6L \end{pmatrix} = \begin{pmatrix} 1-0,6L & 0 & -0,5L \\ 0 & 1-0,6L & -0,25L \\ 0 & -0,25L & 1-0,6L \end{pmatrix}$$

$$\det A(L) = (1 - 0,6L)(1 - 0,85L)(1 - 0,35L) = 0 \rightarrow \text{имеет корни } \frac{1}{0,6}; \frac{1}{0,85}; \frac{1}{0,35} \rightarrow$$

модель стабильна.

Из третьего уравнения $Z_{t-1} = 0,25X_{t-2} + 0,6Z_{t-2} + \varepsilon_{3,t-1}$, так что

$$Y_t = 0,6Y_{t-1} + 0,5Z_{t-1} + \varepsilon_{1t} = 0,6Y_{t-1} + 0,5(0,25X_{t-2} + 0,6Z_{t-2} + \varepsilon_{3,t-1}) + \varepsilon_{1t},$$

$$Y_t = 0,6Y_{t-1} + 0,125X_{t-2} + 0,3Z_{t-2} + \varepsilon_{1t} + 0,5\varepsilon_{3,t-1}.$$

В рамках последнего уравнения прошлые значения переменной X_t помогают в предсказании значения Y_t , так что $x \xrightarrow{G} y$.

Построив реализацию указанной модели с помощью объекта Model, образовать объект Group, содержащий три смоделированных ряда Y_t, X_t, Z_t . В меню этого объекта выбрать: View \rightarrow Granger Causality \rightarrow Lags to Include=1.

Проинтерпретировать результаты, представленные в полученной таблице. Пояснить, почему гипотеза о том, что переменная X не является G-причиной для Y, может быть отвергнутой.

Изменить глубину запаздываний, полагая Lags to Include=2. Выяснить, изменился ли результат проверки гипотезы $x \xrightarrow{G} y$ и почему.

Проверить ту же гипотезу, не прибегая к встроенной проверке, а оценивая непосредственно уравнение

$$Y_t = c(1)Y_{t-1} + c(2)Y_{t-2} + c(3)X_{t-1} + c(4)X_{t-2} + \varepsilon_t$$

и проверяя гипотезу $c(3) = c(4) = 0$. Сравнить: совпало ли значение полученной F – статистики со значением, приведенным в таблице, полученной в рамках объекта Group. Объяснить причины [2].

Темы докладов:

1. Проверка наличия причинности по Грейнджеру.
2. Методология VAR, возникающие при этом затруднения.

Типовые оценочные материалы по теме 8.**Вариант практического задания:**

Рассмотреть цензурированную [1] регрессию или тобит-модель, где $y^* = x'\beta + \varepsilon$, ε независимо и одинаково распределены, и значения наблюдаемо, если и не определено, если $N[0, \sigma^2]$, и значение y наблюдаемо, если $y^* > 0$ и неопределенно, если $y^* \leq 0$.

Предположить, что количество цензурированных наблюдений y равно N_0 и y_0 их обозначает.

Ввести латентную переменную z , которая соответствует цензурированным наблюдениям, то есть $z_i < 0$ для $i - 20$ цензурированного наблюдения.

Для генерирования латентных переменных z_i может использоваться метод пополнения данных.

Латентные переменные здесь представляют собой множество независимых случайных величин и имеют усеченное нормальное распределение на интервале $(-\infty; 0)$ и плотность распределения равна $\phi(z_i | y_i, \beta, \sigma^2) / (1 - \Phi(x_j' \beta / \sigma))$, $-\infty < z_i < 0$, где ϕ и Φ являются функцией плотности и функцией распределения нормальной величины.

Принять, что β величина имеет нормальное распределение, а σ^{-2} гамма априорное распределение.

Показать, что возможно явно получить условные распределения для z_i, β, σ^{-2} .

Используя предыдущие результаты кратко описать алгоритм Гиббса для симуляции значений z_i, β, σ^{-2} .

Показать, как могут быть получены разумные стартовые значения β, σ^{-2} .

Темы докладов:

1. Сэмплирование по Гиббсу.
2. Алгоритм Метрополиса.
3. Алгоритм Метрополиса-Гастингса.
4. Фильтр Калмана.

Типовые оценочные материалы по теме 9.

Вариант практического задания:

Рассмотреть связь рынка государственных облигаций (ГКО) и рынка корпоративных ценных бумаг (Российская торговая система, РТС) (Peresetsky, Ivanter, 2000)(.). $blcp_t$ и gko_t – ежедневные значения индексов «голубых фишек» (наиболее ликвидных акций) и государственных облигаций. Обозначить через X_t разность однодневных доходностей двух рынков [5]:

$$X_t = \ln \frac{blcp_t}{blcp_{t-1}} - \ln \frac{gko_t}{gko_{t-1}}.$$

Рассмотреть модель выравнивания доходностей двух рынков:

$$\Delta X_t = const + \mu X_{t-1} + \varepsilon_t.$$

Здесь $\Delta X_t = X_t - X_{t-1}$. Параметр μ имеет смысл скорости выравнивания доходностей и показывает степень интеграции рынков. Оценить GARCH (1,1) модель на интервале 10.01.96 – 10.10.97 (использовать программу Eviews).

Темы докладов:

1. Модели с эффектом рычага: EGARCH, TGARCH.
2. Модель GARCH-in-Mean.
3. Многомерные модели GARCH.

Типовые оценочные материалы по теме 10.

Вариант практического задания: Смоделируйте реализации 5 рядов

$x_t, z_t, x_{1t}, x_{2t}, x_{3t}$, следуя процессу порождения данных:

$$x_{1t} = 1,5x_{1,t-1} - 0,5x_{1,t-2} + \varepsilon_{1t}, \quad x_{11} = x_{12} = 0,$$

$$x_{2t} = 1,5x_{2,t-1} - 0,5x_{2,t-2} + \varepsilon_{2t}, \quad x_{21} = x_{22} = 0,$$

$$x_{3t} = 1,5x_{3,t-1} - 0,5x_{3,t-2} + \varepsilon_{3t}, \quad x_{31} = x_{32} = 0,$$

$$y_t = 1,5x_{1t} + x_{2t} + x_{3t} + \varepsilon_{4t},$$

$$z_t = 10 + x_{1t} + x_{2t} + \varepsilon_{5t},$$

где $\varepsilon_{1t}, \varepsilon_{2t}, \varepsilon_{3t}, \varepsilon_{4t}, \varepsilon_{5t}$, — независимые друг от друга процессы гауссовского белого шума с дисперсиями, равными 1 для $\varepsilon_{1t}, \varepsilon_{2t}, \varepsilon_{3t}$ и равными 2 для $\varepsilon_{4t}, \varepsilon_{5t}$.

Рассмотреть полученные реализации как статистические данные и используя процедуру Йохансена в пакете *EViews*:

- 1) оцените ранг коинтеграции системы 5 рядов. Соответствует ли оцененное значение теоретическому значению?
- 2) оцените модель коррекции ошибок, соответствующую оцененному рангу коинтеграции. Сравните оцененную модель с теоретической [2].

Типовые оценочные материалы по теме 11.

Темы докладов:

1. Проверка гипотезы единичного корня и нелинейные преобразования временных рядов.
2. Оценивание ранга коинтеграции методом Йохансена.
3. Динамический метод наименьших квадратов.

4.2. Промежуточная аттестация

4.2.1. Перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения образовательной программы. Показатели и критерии оценивания компетенций с учетом этапа их формирования

| Код компетенции | Наименование компетенции | Код этапа освоения компетенции | Наименование этапа освоения компетенции |
|-----------------|--|--------------------------------|--|
| УК ОС-1 | Способность применять критический анализ и системный подход для решения профессиональных задач | УК ОС-1.2 | Способность анализировать и обобщать экономическую и финансовую информацию |
| УК ОС-2 | Способность применять проектный подход при решении профессиональных задач | УК ОС-2.2. | Способность моделировать финансовые ситуации и применять построенные модели при проектировании |

| Этап освоения компетенции | Показатель оценивания | Критерий оценивания |
|--|--|--|
| УК ОС-1.2 Способность анализировать и обобщать экономическую и финансовую информацию | Способность анализировать модели и методы эконометрического анализа, основы эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов. Способность решать задачи на определение детерминации и значимости. Способность применять математический аппарат при обработке и интерпретации статистических данных. Способность применять различные способы и методы анализа в исследовательской деятельности. | Анализирует модели и методы эконометрического анализа, основы эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов. Решает задачи на определение детерминации и значимости. Применяет математический аппарат при обработке и интерпретации статистических данных. Проводит исследование деятельности корпорации, её соответствие целям и задачам хозяйственного развития, прогнозирует возможное развитие в будущем. Анализирует изученные документы организации. |
| УК ОС-2.2. Способность моделировать финансовые ситуации и применять построенные модели при проектировании | Способность проводить исследование деятельности экономического субъекта, соответствие целям и задачам хозяйственного развития, прогнозировать возможное развитие в будущем | Знает базовые, теоретические основы в области экономической деятельности организации Умеет строить экономические модели и проектировать финансовые ситуации |

4.2.2. Форма и средства (методы) проведения промежуточной аттестации

Экзамен проводится с применением следующих методов (средств): устного опроса и практического задания.

4.2.3 Типовые оценочные средства

Список вопросов для подготовки к экзамену

Список вопросов для подготовки к экзамену

1. Этапы эмпирического анализа экономических задач.
2. Классическая линейная модель регрессии.
3. Оценка методом наименьших квадратов.
4. Метод моментов.
5. МНК-оценки для множественной регрессии.
6. Теорема Гаусса – Маркова.
7. Построение доверительных множеств и проверка гипотез.
8. Асимптотические свойства МНК-оценок.
9. Выбор функциональной формы. Ошибки спецификации.
10. Проблема мультиколлинеарности.
11. Проблема гетероскедастичности.
12. Тестирование гипотез при наличии гетероскедастичности.
13. Тестирование на присутствие гетероскедастичности.
14. Обобщенный МНК.
15. Доступный ОМНК.
16. Эндогенность. Источники эндогенности.
17. Смещение в МНК-оценках из-за эндогенности.
18. Инструментальные переменные. Требования к инструментальным переменным.
19. 2-ступенчатый МНК.
20. Проблемы 2-ступенчатого МНК.
21. Слабые инструменты. Тесты на эндогенность.
22. Тест условий сверхидентификации.
23. МНК для систем уравнений.
24. Экзогенность объясняющих переменных. Строгая экзогенность.
25. Примеры систем: внешне не связанные уравнения (SUR), панельные данные.
26. Вид матрицы ковариации ошибок.
27. Оценка объединенным МНК.
28. Оценка ОМНК и доступным ОМНК.
29. Оценка внешне не связанных уравнений с ограничениями на параметры.
30. Оценка систем уравнений с помощью инструментальных переменных.
31. 2-ступенчатый МНК для систем уравнений.
32. 3-ступенчатый МНК.
33. Обобщенный метод моментов.
34. Матрицы весов. Оптимальная матрица весов.

35. Выбор метода оценки систем. Тестирование гипотез.
36. Системы одновременных уравнений.
37. Условия исключения. Сокращенная форма. Линейные ограничения общего вида.
38. Условия идентификации, отсутствия идентификации, точной идентификации и сверхидентификации.
39. Эффективная оценка параметров сокращенной формы.
40. Идентификация на основе произвольных ограничений между уравнениями.
41. Идентификация на основе ограничений на матрицу ковариации.
42. Нелинейность по эндогенным переменным.
43. Проблема пропущенных переменных
44. Фиксированные эффекты, случайные эффекты.
45. Предположения об ошибках: строгая экзогенность объясняющих переменных, поперечная экзогенность.
46. Оценки уравнения в разностях.
47. Оценки панелей со случайными эффектами.
48. Оценки панелей с фиксированными эффектами. Тест Хаусмана.
49. Кластеризация наблюдений.
50. Дискретные зависимые переменные.
51. Линейная модель вероятности.
52. Пробит-модель.
53. Логистическая модель.
54. Оценка методом максимального правдоподобия.
55. Эндогенность в объясняющих переменных.
56. Множественная логистическая модель.
57. Упорядоченные логистические и пробит-модели.
58. Цензурированные регрессии и неслучайные выборки.
59. Тобит-модели.
60. Гетерогенность и эндогенность в тобит-моделях.
61. Селективная выборка. тестирование и коррекция смещения селективной выборки.
62. Оценка программ и экспериментов.
63. Проблема дизайна экспериментов и самоотбор.
64. Методы оценки с использованием propensity score.
65. Методы оценки с использованием инструментальных переменных.

66. Сглаживание временного ряда.
67. Прогнозирование будущих значений временного ряда.
68. Скользящие средние. Фильтр Ходрика – Прескотта.
69. Простое экспоненциальное сглаживание.
70. Двойное экспоненциальное сглаживание, метод Брауна.
71. Метод Хольта. Метод Хольта – Винтерса.
72. Фильтр Бакстера – Кинга.
73. Прогнозирование по моделям ARMA.
74. Прогнозирование по моделям ARIMA.
75. Понятия причинности по Грейнджеру и блочной экзогенности одной группы переменных относительно другой группы переменных.
76. Методология VAR и ее инструментарий (функции импульсного отклика и декомпозиции дисперсий ошибок прогнозов).
77. Суть байесовского подхода, его отличие от частотного (классического) подхода.
78. Переход от априорного распределения к апостериорному.
79. Сопряженные распределения.
80. Байесовские точечные оценки.
81. Байесовские доверительные интервалы.
82. Байесовская проверка гипотез.
83. Байесовские выводы в модели нормальной линейной регрессии.
84. Методы получения выборок из апостериорного распределения.
85. Сэмплирование по Гиббсу.
86. Алгоритм Метрополиса.
87. Алгоритм Метрополиса – Гастингса.
88. Байесовский подход в моделях пространства состояний.
89. Фильтр Калмана.
90. Конструкция алгоритма.
91. Фильтрация и сглаживание.
92. Структурные модели временных рядов.
93. Байесовские VAR.
94. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью; мотивация к их использованию.
95. Модель ARCH, ее недостатки.
96. Тестирование на ARCH-эффект.
97. Модели AR/ARCH.

98. Стандартизованные остатки.
99. Обобщенная ARCH-модель (GARCH), ее преимущества и недостатки.
100. Тестирование на GARCH эффект.
101. Модели AR/GARCH.
102. Модель IGARCH.
103. Модели с эффектом рычага: EGARCH, TARCH.
104. Кривая влияния новостей.
105. Проверка гипотезы об отсутствии асимметрии влияния плохих и хороших новостей.
106. Компонентная GARCH.
107. Модель GARCH-in-Mean.
108. Многомерные модели GARCH.
109. Дробно-интегрированные временные ряды.
110. Модель ARFIMA.
111. Проверка гипотезы единичного корня
112. Нелинейные преобразования временных рядов.
113. Выбор между проверкой наличия единичного корня в уровнях и проверкой наличия единичного корня в логарифмах уровней.
114. Проверка гипотез о наличии у временного ряда сезонных единичных корней.

Примерные варианты экзаменационных билетов:

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 1

по дисциплине «Эконометрика (продвинутый уровень)»

1. Экзогенность объясняющих переменных. Строгая экзогенность.
2. Тестирование на ARCH-эффект.
3. Для каждого из трех уравнений выяснить, выполняются ли порядковые и ранговые условия идентифицируемости [5]:

$$\begin{cases} P_t + \beta_{12}W_t + \gamma_{11}Q_t + \gamma_{13}P_{t-1} = \varepsilon_{1t} \\ \beta_{21}P_t + W_t + \beta_{23}N_t + \gamma_{22}S_t + \gamma_{24}W_{t-1} = \varepsilon_{2t} \\ \beta_{32}W_t + N_t + \gamma_{32}S_t + \gamma_{33}P_{t-1} + \gamma_{34}W_{t-1} = \varepsilon_{3t} \end{cases},$$

где P_t, W_t, N_t - индекс цен, зарплата, профсоюзный взнос соответственно (эндогенные переменные), а Q_t и S_t - производительность труда и количество забастовок (экзогенные переменные).

Повторить проверку при дополнительных ограничениях: $\gamma_{32} = 0$; $\gamma_{32} = 1$; $\gamma_{32} = \gamma_{33}$.

ЭКЗАМЕНАЦИОННЫЙ БИЛЕТ № 2

по дисциплине «Эконометрика (продвинутый уровень)»

1. Инструментальные переменные. Требования к инструментальным переменным.
2. Многомерные модели GARCH.
3. Рассмотреть модель бинарного выбора $P(y_t = 1) = F(\alpha + \beta d_t)$, где d - фиктивная переменная (принимаяющая значения 0 и 1). Результаты 100 наблюдений представлены в виде таблиц [5]:

| | $y = 0$ | $y = 1$ |
|---------|---------|---------|
| $d = 0$ | 20 | 32 |
| $d = 1$ | 36 | 12 |

Оценить параметры α, β , используя: logit-модель; probit-модель. В двух случаях проверить гипотезу $H_0 : \beta = 0$ и сравнить выводы.

Шкала оценивания

Оценку «отлично» заслуживает студент, если анализирует модели и методы эконометрического анализа и проектировать финансовые ситуации, знает основы эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов, решает задачи на определение детерминации и значимости, применяет математический аппарат при обработке и интерпретации статистических данных, проводит исследование деятельности корпорации, её соответствие целям и задачам хозяйственного развития, прогнозирует возможное развитие в будущем, анализирует изученные документы организации, знает базовые, теоретические основы в области экономической деятельности организации

Оценку «хорошо» заслуживает студент, который анализирует модели и методы эконометрического анализа, знает основы эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов, решает задачи, при помощи дополнительных источников, на определение детерминации и значимости, применяет математический аппарат при обработке и интерпретации статистических данных, частично проводит исследование деятельности корпорации, её соответствие целям и задачам хозяйственного развития, в определенной мере прогнозирует возможное развитие в будущем, анализирует изученные документы организации, знает базовые, теоретические основы в области экономической деятельности организации

Оценки «удовлетворительно» заслуживает студент, допустивший ошибки в раскрытии понятий, употреблении терминов. Практически не анализирует модели и методы эконометрического анализа, знает основы эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов, но применять их не может, решает задачи на

определение детерминации и значимости, знает математический аппарат при обработке и интерпретации статистических данных, но не применяет его, проводит исследование деятельности корпорации, её соответствие целям и задачам хозяйственного развития, но не делает системные выводы, не прогнозирует возможное развитие в будущем, частично анализирует изученные документы организации, знает базовые, теоретические основы в области экономической деятельности организации

Оценка «неудовлетворительно» выставляется студенту, не анализирует модели и методы эконометрического анализа, не знает основы эконометрических методов, необходимых для решения теоретических и практических задач исследования массовых общественных явлений и процессов, не решает задачи на определение детерминации и значимости, не применяет математический аппарат при обработке и интерпретации статистических данных, не проводит исследование деятельности корпорации, её соответствие целям и задачам хозяйственного развития, не прогнозирует возможное развитие в будущем, не анализирует изученные документы организации, не знает базовые, теоретические основы в области экономической деятельности организации

Ответы на вопросы отсутствуют. Отказ от ответа.

4.3. Методические материалы

Методические материалы, позволяющие оценивать знания и умения обучающихся при проведения промежуточной аттестации

Процедура проведения устного экзамена

Аттестационные испытания проводятся преподавателем, ведущим лекционные занятия по данной дисциплине. Во время аттестационных испытаний обучающиеся могут пользоваться программой учебной дисциплины, а также с разрешения преподавателя калькуляторами. Время подготовки ответа при сдаче экзамена в устной форме должно составлять не менее 20 минут (по желанию обучающегося ответ может быть досрочным). Время ответа – не более 15 минут. При подготовке к устному экзамену экзаменуемый, как правило, ведет записи в листе устного ответа, который затем (по окончании экзамена) сдается экзаменатору.

При проведении устного экзамена экзаменационный билет выбирает сам экзаменуемый в случайном порядке. Экзаменатору предоставляется право задавать обучающимся дополнительные вопросы в рамках программы дисциплины текущего семестра, а также, помимо теоретических вопросов, давать задачи, которые изучались на практических занятиях. Оценка результатов устного аттестационного испытания

объявляется обучающимся в день его проведения. При проведении устного экзамена в аудитории могут одновременно находиться не более шести экзаменуемых. По окончании ответа на вопросы билета экзаменатор может задать экзаменуемому дополнительные и уточняющие вопросы в пределах учебного материала, вынесенного на экзамен.

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины

Самоподготовка к практическим занятиям

При подготовке к практическому занятию необходимо помнить, что та или иная дисциплина тесно связана с ранее изучаемыми курсами. Более того, именно синтез полученных ранее знаний и текущего материала по курсу делает подготовку результативной и всесторонней.

На семинарских занятиях студент должен уметь последовательно излагать свои мысли и аргументированно их отстаивать.

Для достижения этой цели необходимо:

- 1) ознакомиться с соответствующей темой программы дисциплины;
- 2) осмыслить круг изучаемых вопросов и логику их рассмотрения;
- 3) изучить рекомендованную литературу по данной теме;
- 4) тщательно изучить лекционный материал;
- 5) ознакомиться с вопросами очередного семинарского занятия;
- 6) подготовить краткое выступление по каждому из вынесенных на семинарское занятие вопросу.

Изучение вопросов очередной темы требует глубокого усвоения теоретических основ дисциплины, раскрытия сущности основных экономических категорий, проблемных аспектов темы и анализа фактического материала.

При презентации материала на семинарском занятии можно воспользоваться следующим алгоритмом изложения темы: определение и характеристика основных категорий, эволюция предмета исследования, оценка его современного состояния, существующие проблемы, перспективы развития.

Методические указания по выполнению рефератов, докладов

В работе должны быть изложены актуальность выбранной темы, его современное состояние, проблемы и подходы к их решению. В работе должен быть изложено авторское видение исследуемой проблемы и возможные пути ее решения. При необходимости должны быть выполнены аналитические расчеты, подтверждающие позицию автора, и раскрывающие эффективность предлагаемых решений.

Структура реферата, доклада:

- 1) титульный лист;
- 2) содержание, в котором указываются названия всех разделов реферата и соответствующие номера страниц;
- 3) введение объемом 1-2 страницы;
- 4) основная часть реферата, которая может состоять из нескольких разделов и предполагает осмысленное и логичное изложение главных положений и идей, содержащихся в изученной литературе;
- 5) заключение, которое содержит главные выводы и итоги из текста основной части, в нем отмечается, как выполнены задачи и достигнуты ли цели, сформулированные во введении;
- 6) приложение, включающее графики, таблицы, расчеты;
- 7) библиография (список литературы), где указывается реально использованная для написания реферата литература.

Объем реферата, доклада составляет 10-18 страниц. Работа выполняется на одной стороне листа формата А4. По обеим сторонам листа оставляются поля, рекомендуется шрифт 12-14, интервал - 1,5. Все листы реферата должны быть пронумерованы. Каждый вопрос в тексте должен иметь заголовок в точном соответствии с наименованием в содержании.

Методические рекомендации по подготовке к промежуточной аттестации

При подготовке к промежуточной аттестации ознакомьтесь со списком представленных вопросов. Формулируйте ответ с точки зрения применения различных методов анализа данных. Необходимо дать аргументированный ответ, подтверждающий уровень освоения компетенции.

6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы обучающихся по дисциплине

6.1. Основная литература.

1. Колин, Кэмерон Микроэконометрика. Книга 1 [Электронный ресурс] : методы и их применения / Э. Кэмерон Колин, Правин Триведи К. ; пер. С. Аванян [и др.]. — Электрон. текстовые данные. — М. : Дело, 2015. — 551 с. — 978-5-7749-0955-1. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/77351.html>
2. Колин, Кэмерон Микроэконометрика. Книга 2 [Электронный ресурс] : методы и их применения / Э. Кэмерон Колин, Правин Триведи К. ; пер. С. Аванян [и др.]. — Электрон.

текстовые данные. — М. : Дело, 2015. — 664 с. — 978-5-7749-0956-8. — Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/77352.html>

3. Грин, У.Г. Эконометрический анализ. Кн. 1 / У. Грин ; пер. с англ. ; под науч. ред. С.С. Синельникова, М.Ю. Турунцевой. — Москва : Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2016. — 760 с. - (Академический учебник). - ISBN 978-5-7749-1157-8. - Режим доступа:

<https://new.znaniium.com/catalog/product/1043304>

4. Грин, У.Г. Эконометрический анализ. Кн. 2 / У. Грин ; пер. с англ. ; под науч. ред. С.С. Синельникова, М.Ю. Турунцевой. — Москва : Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2016. — 752 с. - (Академический учебник). - ISBN 978-5-7749-1158-5. - Режим доступа:

<https://new.znaniium.com/catalog/product/1043306>

6.2. Дополнительная литература

1. Jeffrey M. Wooldridge (2012) Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, MIT press (электронный доступ через Ebrary <http://site.ebrary.com/lib/ranepa>)

2. Кеннеди, П. Путеводитель по эконометрике. Кн. 1. / П. Кеннеди ; пер. с англ. ; под науч. ред. В.П. Носко. — Москва : Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2016. — 528 с. - (Академический учебник). <https://new.znaniium.com/catalog/product/1043270>

3. Кеннеди, П. Путеводитель по эконометрике. Кн. 2 / П. Кеннеди ; пер. с англ.; под науч. ред. В.П. Носко. — Москва : Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2016. — 512 с. - (Академический учебник). <https://new.znaniium.com/catalog/product/1043268>

4. Хайяши, Ф. Эконометрика / Ф. Хайяши ; пер. с англ. под науч. ред. В.П. Носко. — Москва : Издательский дом «Дело» РАНХиГС, 2017. — 728 с. — (Академический учебник). <https://new.znaniium.com/catalog/product/1043302>

6.3. Учебно-методическое обеспечение самостоятельной работы

Не предусмотрено.

6.4. Нормативные правовые документы.

Не предусмотрено.

6.5. Интернет-ресурсы.

1. www.cbr.ru – Центральный банк России
2. minfin.ru – Министерство финансов России
3. www.gks.ru – Госкомстат России
4. www.rbc.ru – Информационное агентство «Росбизнесконсалтинг» (Россия)
5. www.worldbank.org – Всемирный банк
6. www.imf.org – Международный валютный фонд

7. <https://www.hse.ru/info> – Государственный университет – Высшая школа экономики (Россия)
8. www.beafnd.org - Бюро экономического анализа (Россия)
9. <http://www.libertarium.ru/library> - Библиотека материалов по экономической тематике
10. www.esfor.ru РАН Институт народнохозяйственного прогнозирования.
11. http://www.economicsnetwork.ac.uk/links/data_free - На этом сайте имеется большое количество ссылок на различные сайты, содержащие в свободном доступе данные экономической статистики.
12. <http://www.census.gov/ipc/www/idb> - Международная база данных Бюро переписи населения США / U.S. Census Bureau -International DataBase (IDB).
13. <http://www.econ.kuleuven.be/gme/data.htm> - Статистические данные, использованные в книге: Вербик М. (2008). Путеводитель по современной эконометрике. М., Научная книга.
14. http://economist.mrsu.ru/info/kaf_statistic/poleznie_ssilki.html - Полезные ссылки на сайты, на которых прикладной экономист может найти данные для исследований.
15. <http://www.feweb.vu.nl/econometriclinks/slinks/> - На этом сайте имеется большое количество ссылок на различные интернет-ресурсы, посвященные изучению, разработке и применению эконометрических методов.
16. http://www.economicsnetwork.ac.uk/links/data_free
17. На этом сайте имеется большое количество ссылок на различные сайты, содержащие в свободном доступе данные экономической статистики.
18. <http://www.census.gov/ipc/www/idb>
19. Международная база данных Бюро переписи населения США / U.S. Census Bureau - International Data Base (IDB).
20. <http://www.econ.kuleuven.be/gme/data.htm>
21. Статистические данные, использованные в книге: Вербик М. (2008). Путеводитель по современной эконометрике. М., Научная книга.
22. http://economist.mrsu.ru/info/kaf_statistic/poleznie_ssilki.html
23. Полезные ссылки на сайты, на которых прикладной экономист может найти данные для исследований.
24. <http://www.feweb.vu.nl/econometriclinks/slinks/>
25. На этом сайте имеется большое количество ссылок на различные интернет-ресурсы, посвященные изучению, разработке и применению эконометрических методов

6.6. Иные источники.

1. Носко, В.П. Эконометрика. Кн. 2. Ч. 3, 4 [Электронный ресурс] : учебник / В.П. Носко. — Электрон. дан. — Москва: Издательский дом "Дело" РАНХиГС, 2011. — 576 с.
2. Kozhan R. Financial Econometrics with Eviews.
3. Gusti Ngurah Agung. Time Series Data Analisis Using Eviews.
4. Магнус, Я. Р., Катышев, П. К., Пересецкий, А. А. Эконометрика. Начальный курс: учебник: гриф МО / Я. Р. Магнус, П. К. Катышев, А. А. Пересецкий. - 8-е изд. - М.: Дело, 2007.- 504 с. - ISBN 978-5-7749-0473-0: 231-00.
5. Вербик М. (2008). Путеводитель по современной эконометрике. М., Научная книга.
6. [БД-1] База данных «Оценки совокупной факторной производительности российских фирм обрабатывающей промышленности с информацией по географической локализации»
7. [БД-2] База данных «Индексы совместной локализации для пар отраслей обрабатывающей промышленности России».

7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

Базы данных, информационно-справочные и поисковые системы

1. www.biblio-online.ru –Электронно-библиотечная система [ЭБС] Юрайт;
2. <http://www.iprbookshop.ru> – Электронно-библиотечная система [ЭБС] «Iprbooks»
3. <https://e.lanbook.com> - Электронно-библиотечная система [ЭБС] «Лань».
4. <http://elibrary.ru/> - Научная электронная библиотека Elibrary.ru.
5. <https://new.znanium.com> Электронно-библиотечная система [ЭБС] «Znanium.com».
6. <https://dlib.eastview.com> – Информационный сервис «East View».
7. <https://www.jstor.org> - Jstor. Полные тексты научных журналов и книг зарубежных издательств.
8. <https://elibrary.worldbank.org> - Электронная библиотека Всемирного Банка.
9. <https://link.springer.com> - Полнотекстовые политематические базы академических журналов и книг издательства Springer.
10. <https://ebookcentral.proquest.com> - Ebook Central. Полные тексты книг зарубежных научных издательств.
11. <https://www.oxfordhandbooks.com> - Доступ к полным текстам справочников Handbooks издательства Oxford по предметным областям: экономика и финансы, право, бизнес и управление.
12. <https://journals.sagepub.com> - Полнотекстовая база научных журналов

академического издательства Sage.

13. Справочно-правовая система «Консультант».
14. Электронный периодический справочник «Гарант».

Программные, технические и электронные средства обучения и контроля знаний.

Для проведения лекций необходима аудитория с презентационным оборудованием, компьютер под управлением операционной системы Windows с доступом в Интернет и установленным программным обеспечением Microsoft Office (Word, PowerPoint, Excel) и Adobe Reader.

Для лабораторных занятий необходим компьютерный класс, оснащённый компьютерами под управлением операционной системой Windows с доступом в Интернет и установленным прикладным программным обеспечением EViews 9, либо пакеты Gretl или R, Stata (версии не ниже 10) либо пакетR, Microsoft Office (Word, PowerPoint, Excel) и Adobe Reader. Компьютер преподавателя должен быть оснащен проектором.