

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

Алтайский филиал

УТВЕРЖДЕНО  
Решением Ученого совета Алтайского  
филиала РАНХиГС  
Протокол от «25» апреля 2024 г. №8

**ОБРАЗОВАТЕЛЬНАЯ ПРОГРАММА ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ**

Экономика и цифровая трансформация

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

Б1.О.03 Эконометрика (продвинутый уровень)

магистратура

38.04.01 Экономика

заочная

Год набора - 2025

Барнаул, 2024 г.

**Автор – составитель:**

кандидат экономических наук, доцент, доцент кафедры экономики и финансов,  
Воробьев Сергей Петрович

Заведующий кафедрой

экономики и финансов, кандидат экономических наук, доцент, Лукина Елена Викторовна

## СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения программы.....	4
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы.....	5
3. Содержание и структура дисциплины.....	5
4. Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся и оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине.....	8
5. Методические материалы по освоению дисциплины.....	13
6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети Интернет.....	14
6.1. Основная литература.....	14
6.2. Дополнительная литература.....	14
6.3. Нормативные правовые документы и иная правовая информация.....	14
6.4 Интернет-ресурсы.....	14
6.5 Иные источники.....	14
7. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы.....	15

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

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

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
ОПК ОС-3	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа при решении практических и (или) исследовательских задач	ОПК ОС-3.1	Способен применять продвинутое инструментальные методы при решении задач практической направленности
ОПК ОС-5	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении практических и (или) исследовательских задач	ОПК ОС-5.1	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства для обработки информации при решении управленческих и (или) исследовательских задач, ориентированных на практические аспекты деятельности

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

ОТФ / ТФ / трудовые или профессиональные действия	Код этапа освоения компетенции	Результаты обучения
F/01.7 - Определение направлений развития организации	ОПК ОС-3.1	на уровне знаний: знает основные подходы построения, обоснования и проверки адекватности и использования эконометрических моделей
		на уровне умений: разрабатывает эконометрические модели для обоснования и анализа финансово-экономических показателей, анализа социально-значимых проблем и процессов; оценивает условия и последствия принимаемых организационно-управленческих решений; применяет количественные и качественные методы анализа при принятии управленческих решений
		на уровне навыков: владеет методологией экономического исследования, современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных, современной методикой построения эконометрических моделей, методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей
F/01.7 - Определение направлений развития организации	ОПК ОС-5.1	на уровне знаний: знает современные методы эконометрического анализа и основанные на них современные программные продукты, необходимые для исследований
		на уровне умений: применяет современный эконометрический инструментарий для исследований экономических решений на уровне организаций и рынках присутствия организации;
		на уровне навыков: методикой и методологией проведения эконометрических исследований в экономической сфере; навыками самостоятельной исследовательской работы

## 2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

Объем дисциплины: 180 ч, что соответствует 5 зачетным единицам (з. е.).

Количество академических часов и соответствующих им астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем, самостоятельную работу и контроль обучающихся:

	Количество астрономических часов	Количество соответствующих им академических часов
Контактная работа обучающихся с преподавателем	13,5	18
<i>в том числе</i>		
<i>Лекции</i>	6,0	8
<i>Практические занятия/Лабораторные работы</i>	6,0	8
<i>Консультации</i>	1,5	2
Самостоятельная работа	114,75	153
Контроль	6,75	9

Дисциплина Б1.О.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» изучается на 1-ом и 2-ом курсах для заочной формы обучения.

## 3. Содержание и структура дисциплины Заочная форма обучения

№ п/п	Наименование тем	Объем дисциплины, час.						Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий				СР	
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
1.	Регрессионный анализ и эндогенность	24	2		2		20	тестирование
2.	Оценка систем уравнений	24	2		2		20	тестирование
3.	Модели панельных данных	17	2				15	тестирование
4.	Нелинейные модели и отбор	13	2		1		10	тестирование
5.	Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA	11			1		10	тестирование
6.	Причинность и блочная экзогенность	21			1		20	тестирование
7.	Методология векторных авторегрессий (VAR)	21			1		20	тестирование
8.	Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью	14					14	тестирование
9.	Практические вопросы коинтеграционного анализа нестационарных временных рядов. Динамический метод наименьших квадратов	24					24	тестирование
Промежуточная аттестация		9				9		Экзамен

№ п/п	Наименование тем	Объем дисциплины, час.					Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации	
		Всего	Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий					СР
			Л/ ДОТ	ЛР/ ДОТ	ПЗ/ ДОТ	КСР		
	Консультация	2			2			
	<b>Всего</b>	<b>180</b>	<b>8</b>		<b>8</b>	<b>11</b>	<b>153</b>	

## Содержание дисциплины

### Тема 1. Регрессионный анализ и эндогенность.

Этапы эмпирического анализа экономических задач. Типы данных. Структурное и неструктурное моделирование. Причинно-следственная связь и принцип *ceterisparibus*. 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. 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 9. 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 оценочные материалы промежуточной аттестации по дисциплине**

В ходе реализации дисциплины Б1.О.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» используются следующие методы текущего контроля успеваемости обучающихся:

Методы текущего контроля успеваемости

Темы модулей	Форма контроля СР
Регрессионный анализ и эндогенность	Тестирование
Оценка систем уравнений	Тестирование
Модели панельных данных.	Тестирование
Нелинейные модели и отбор	Тестирование
Адаптивные методы анализа временных рядов. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA.	Тестирование
Причинность и блочная экзогенность.	Тестирование
Методология векторных авторегрессий (VAR).	Тестирование
Нелинейные модели временных рядов. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью	Тестирование
Дробно-интегрированные ряды. Нелинейные преобразования и единичные корни. Сезонные единичные корни.	Тестирование

Экзамен проводится с применением следующих методов (средств): либо в устной форме по заданным в билете вопросам, либо в виде тестирования.

#### **Материалы текущего контроля успеваемости обучающихся**

##### **Тесты контроля знаний**

- Мультиколлинеарность – это в эконометрике термин, обозначающий:
  - Метод, позволяющий оценить параметры модели, опираясь на случайные выборки
  - Статистическую зависимость между последовательными элементами одного ряда, которые взяты со сдвигом
  - + Наличие линейной зависимости между факторами (объясняющими переменными) регрессионной модели
- Теорема Гаусса-Маркова в эконометрике опирается на:
  - + Метод наименьших квадратов
  - Метод наименьших модулей
  - Метод инструментальных переменных
- Модели временных рядов в эконометрике – это модели:
  - Которые используются для того, чтобы определить, как себя будет вести тот или иной фактор в течение определенного промежутка времени
  - Которые позволяют максимально точно рассчитать период времени, требующийся для того, чтобы значение фактора изменилось на значимую величину
  - + Для построения которых используются данные, характеризующие один объект за несколько последовательных периодов
- Метод наименьших квадратов в эконометрике – это метод:

- Который используется для расчета наименьших отклонений случайных величин, влияющих на конечный результат

+ Который позволяет решать задачи, опираясь на минимизацию суммы квадратов отклонений некоторых функций от искомым переменных

- Который позволяет оценить значение неизвестного параметра, минимизируя значение функции правдоподобия

5. Зависимая переменная в эконометрике – это:

- Параметр, состоящий из случайной и неслучайной величин

+ Некоторая переменная регрессионной модели, которая является функцией регрессии с точностью до случайного возмущения

- Переменная, которая получается путем перевода качественных характеристик в количественные, т.е. путем присвоения цифровой метки

### Оценочные материалы промежуточной аттестации

Код компетенции	Наименование компетенции	Код компонента компетенции	Наименование компонента компетенции
ОПК ОС-3	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа при решении практических и (или) исследовательских задач	ОПК ОС-3.1	Способен применять продвинутое инструментальные методы при решении задач практической направленности
ОПК ОС-5	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении практических и (или) исследовательских задач	ОПК ОС-5.1	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства для обработки информации при решении управленческих и (или) исследовательских задач, ориентированных на практические аспекты деятельности

Компонент компетенции	Индикатор оценивания	Критерий оценивания
ОПК ОС-3.1	Без затруднений демонстрирует использование с применением информационно-коммуникационных технологий современных методов сбора, обработки и анализа данных, методик построения эконометрических моделей	Без затруднений демонстрирует навыки работы с современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных, современной методикой построения эконометрических моделей, методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью стандартных теоретических и эконометрических моделей
ОПК ОС-5.1	Применяет современный эконометрический инструментарий для обработки информации при принятии решений на уровне экономического агента	Без затруднений применяет современный эконометрический инструментарий для исследований экономических решений на уровне организаций и рынках присутствия организации

### Типовые оценочные материалы промежуточной аттестации

Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в виде экзамена, который проводится в устной форме ответа на вопросы и дополнительные вопросы.

Промежуточная аттестация проводится с соблюдением следующих требований по процедуре в устной форме. На экзамене обучающиеся самостоятельно готовят ответы на

вопросы билета промежуточной аттестации по дисциплине. Одновременно присутствуют на промежуточной аттестации не более 8 человек (подготовка ответа, ответ преподавателю). Обучающийся при входе в аудиторию при себе имеет только письменные принадлежности (ручку или карандаш). Бумагу, необходимую для подготовки, выдает преподаватель. Обучающийся берет билет, ему предоставляется 30 минут для подготовки устного ответа на вопросы билета.

Оценка знаний обучающегося носит комплексный характер и определяется ответом на экзамене.

Выполнение всех заданий текущего контроля является желательным для всех обучающихся.

Оценка знаний обучающегося на экзамене является балльной («отлично»/ «хорошо» / «удовлетворительно» / «неудовлетворительно»).

### **Примерный перечень вопросов для подготовки к экзамену**

1. Этапы эмпирического анализа экономических задач. Типы данных. Структурное и неструктурное моделирование.
2. Причинно-следственная связь и принцип *ceterisparibus*. Условное математическое ожидание. Классическая линейная модель регрессии.
3. Оценка методом наименьших квадратов. Вывод МНК-оценок. Подобранные значения и остатки. Качество подбора.
4. Коэффициенты регрессии, изменение масштаба. Простейшие способы учета нелинейности.
5. Моменты МНК-оценок, их несмещенность, дисперсия оценок.
6. Оценка дисперсии ошибок. Модель регрессии с многими объясняющими переменными. МНК-оценки для множественной регрессии.
7. Теорема Гаусса – Маркова. Оценка дисперсии ошибки.
8. Матрица ковариации оценок. Интерпретация коэффициентов. Оценивание условного ожидания и прогнозирование.
9. Построение доверительных множеств и проверка гипотез. Распределения МНК-оценок коэффициентов и остаточной суммы квадратов, t-статистика.
10. Доверительные интервалы для отдельных коэффициентов, основанные на значениях t-статистик.
11. 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 (Р-значение).
12. Случайные регрессоры. Асимптотические свойства МНК-оценок. Состоятельность. Тестирование гипотез с использованием асимптотических свойств.
13. Тестирование произвольных ограничений на коэффициенты. F-статистика. Проблемы множественной регрессионной модели. Выбор функциональной формы. Ошибки спецификации.
14. Тестирование на ошибки спецификации. Коррелированные регрессоры. Проблема мультиколлинеарности.
15. Пропущенные переменные. Смещение оценок. Прокси-переменные.
16. Бинарные и дискретные объясняющие переменные. Сгенерированные регрессоры. Переменные, измеренные с ошибкой.
17. Неслучайная выборка и пропущенные наблюдения. Проблема гетероскедастичности. Тестирование гипотез при наличии гетероскедастичности. Тестирование на присутствие гетероскедастичности.
18. Обобщенный МНК. Доступный ОМНК. Эндогенность. Источники эндогенности. Смещение в МНК-оценках из-за эндогенности.

19. Инструментальные переменные. Требования к инструментальным переменным. 2-ступенчатый МНК.
20. Состоятельность, асимптотическая нормальность и эффективность. Тестирование гипотез. Тестирование гипотез в присутствии гетероскедастичности.
21. Проблемы 2-ступенчатого МНК. Слабые инструменты.
22. Тесты на эндогенность. Тест условий сверхидентификации.
23. МНК для систем уравнений. Экзогенность объясняющих переменных.
24. Строгая экзогенность. Примеры систем: внешне не связанные уравнения (SUR), панельные данные. Вид матрицы ковариации ошибок.
25. Оценка объединенным МНК. Оценка ОМНК и доступным ОМНК. Асимптотические свойства.
26. Тестирование гипотез. Оценка внешне не связанных уравнений с ограничениями на параметры.
27. Оценка систем уравнений с помощью инструментальных переменных. 2-ступенчатый МНК для систем уравнений. 3-ступенчатый МНК.
28. Обобщенный метод моментов. Матрицы весов. Оптимальная матрица весов. Выбор метода оценки систем. Тестирование гипотез.
29. Системы одновременных уравнений. Экономические задачи, приводящие к системам одновременных уравнений. Идентификация. Условия исключения. Сокращенная форма. Линейные ограничения общего вида.
30. Условия идентификации, отсутствия идентификации, точной идентификации и сверхидентификации. Эффективная оценка параметров сокращенной формы.
31. Идентификация на основе произвольных ограничений между уравнениями. Идентификация на основе ограничений на матрицу ковариации. Нелинейность по эндогенным переменным.
32. Мотивация: проблема пропущенных переменных. Фиксированные эффекты, случайные эффекты.
33. Предположения об ошибках: строгая экзогенность объясняющих переменных, поперIODная экзогенность.
34. Оценки уравнения в разностях. Оценки панелей со случайными эффектами. Оценки панелей с фиксированными эффектами.
35. Тест Хаусмана. Кластеризация наблюдений.
36. Дискретные зависимые переменные. Линейная модель вероятности.
37. Пробит-модель. Логистическая модель. Оценка методом максимального правдоподобия.
38. Эндогенность в объясняющих переменных.
39. Множественная логистическая модель. Упорядоченные логистические и пробит-модели.
40. Цензурированные регрессии и неслучайные выборки.
41. Тобит-модели. Гетерогенность и эндогенность в тобит-моделях. Селективная выборка. Тестирование и коррекция смещения селективной выборки.
42. Сглаживание временного ряда. Прогнозирование будущих значений временного ряда. Скользящие средние. Фильтр Ходрика – Прескотта. Простое экспоненциальное сглаживание.
43. Двойное экспоненциальное сглаживание, метод Брауна. Метод Хольта. Метод Хольта – Винтерса. Фильтр Бакстера – Кинга. Прогнозирование по моделям ARMA, ARIMA.
44. Понятия причинности по Грейнджеру и блочной экзогенности одной группы переменных относительно другой группы переменных.

45. Методология VAR и ее инструментарий (функции импульсного отклика и декомпозиции дисперсий ошибок прогнозов).

46. Сопряженные распределения. Байесовские точечные оценки. Байесовские доверительные интервалы. Байесовская проверка гипотез. Байесовские выводы в модели нормальной линейной регрессии.

47. Методы получения выборок из апостериорного распределения. Сэмплирование по Гиббсу. Алгоритм Метрополиса. Алгоритм Метрополиса – Гастингса. Байесовский подход в моделях пространства состояний. Фильтр Калмана.

48. Конструкция алгоритма. Фильтрация и сглаживание. Структурные модели временных рядов. Байесовские VAR. Априорное распределение Миннесоты/Литтермана.

49. Модели временных рядов с условной гетероскедастичностью; мотивация к их использованию.

50. 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.

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

52. Дробно-интегрированные временные ряды. Модель ARFIMA. Проверка гипотезы единичного корня и нелинейные преобразования временных рядов.

53. 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.

54. Методы оценивания долговременной связи между нестационарными временными рядами.

55. Оценивание в треугольной модели. Оценивание ранга коинтеграции методом Йохансена.

56. Динамический метод наименьших квадратов. Динамический метод наименьших квадратов для коинтегрированных рядов первого порядка интегрированности.

57. Динамический метод наименьших квадратов для системы коинтегрированных рядов, содержащей ряды первого и второго порядков интегрированности.

#### Шкала оценивания (экзамен)

Описание шкалы	Оценка (по 4-балльной шкале)
У обучающегося сформированы уверенные знания, умения и навыки, включенные в соответствующий этап освоения компетенций, он глубоко и полно освещает теоретические, методологические и практические аспекты вопроса, проявляет творческий подход к его изложению и демонстрирует дискуссионность проблематики, а также глубоко и полно раскрывает дополнительные вопросы. Этапы компетенций, предусмотренные рабочей программой, сформированы. Свободное владение материалом. Достаточный уровень знакомства со специальной научной литературой. Практические навыки профессиональной деятельности сформированы. Обучающийся не затрудняется с ответами при видеоизменении заданий, правильно	отлично

обосновывает принятые решения, владеет разносторонними навыками и приемами выполнения практических задач.	
Ставится при полных, исчерпывающих, аргументированных ответах на все основные и дополнительные вопросы. Этапы компетенций, предусмотренные рабочей программой, сформированы. Детальное воспроизведение учебного материала. Практические навыки профессиональной деятельности в значительной мере сформированы. Приемлемое умение самостоятельного решения практических задач с отдельными элементами творчества. Обучающийся твердо знает материал дисциплины, грамотно и по существу излагает его, не допуская существенных неточностей в ответе на вопросы, правильно применяет теоретические положения при решении практических вопросов и задач, владеет необходимыми навыками и приемами их выполнения.	хорошо
Ставится, если этапы компетенций, предусмотренные рабочей программой, сформированы не в полной мере. Наличие минимально допустимого уровня в усвоении учебного материала и в самостоятельном решении практических задач. Практические навыки профессиональной деятельности сформированы не в полной мере. Обучающийся показывает знания только основного материала, но не усвоил его деталей, допускает неточности, неправильные формулировки, нарушения логической последовательности в изложении программного материала, испытывает затруднения при выполнении практических задач	удовлетворительно
Ставится, если обучающийся не знает и не понимает сущности вопросов и предлагаемых задач. Этапы компетенций, предусмотренные рабочей программой, не сформированы. Недостаточный уровень усвоения понятийного аппарата и наличие фрагментарных знаний по программному материалу дисциплины, обучающийся допускает существенные ошибки, неуверенно, с большими затруднениями решает практические задачи или не справляется с ними самостоятельно. Отсутствие минимально допустимого уровня в самостоятельном решении практических задач. Практические навыки профессиональной деятельности сформированы в недостаточном объеме.	неудовлетворительно

## 5. Методические материалы по освоению дисциплины

*Методические указания по самостоятельной подготовке к занятиям лекционного, практического (семинарского) типа:*

Подготовка к занятиям должна носить систематический характер. Это позволит обучающемуся в полном объеме выполнить все требования преподавателя. Обучающимся рекомендуется изучать как основную, так и дополнительную литературу, а также знакомиться с Интернет-источниками (список приведен в рабочей программе по дисциплине).

*Методические рекомендации по выполнению тестовых заданий*

Для выполнения тестового задания, прежде всего, следует внимательно прочитать поставленный вопрос. После ознакомления с вопросом следует приступать к прочтению предлагаемых вариантов ответа. Необходимо прочитать все варианты и выбрать один/несколько правильных ответов (в зависимости от вопроса).

На выполнение теста отводится ограниченное время. Оно может варьироваться в зависимости от уровня тестируемых, сложности и объема теста. Как правило, время выполнения тестового задания определяется из расчета 45-60 секунд на один вопрос.

Критерии оценки выполненных студентами тестов определяются преподавателем самостоятельно. Рекомендуются следующие критерии оценки:

1. 80-100% правильных ответов – «отлично»;
2. 66-79% правильных ответов – «хорошо»;
3. 55-65% правильных ответов – «удовлетворительно»;
4. менее 55% правильных ответов – «неудовлетворительно».

При подведении итогов по выполненной работе рекомендуется проанализировать допущенные ошибки, прокомментировать имеющиеся в тестах неправильные ответы.

## **6. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети Интернет**

### **6.1 Основная литература**

1. Мардас, А. Н. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / А. Н. Мардас. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 180 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8164-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/537389>
2. Демидова, О. А. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / О. А. Демидова, Д. И. Малахов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 398 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-20392-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/558116>
3. Евсеев, Е. А. Эконометрика : учебное пособие для вузов / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 186 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10752-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/539152>

### **6.2 Дополнительная литература**

1. Эконометрика : учебник для вузов / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2021. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/468366>.

### **6.3. Нормативные правовые документы и иная правовая информация не предполагается.**

### **6.4 Интернет-ресурсы**

1. <https://minfin.gov.ru/> - Министерство финансов Российской Федерации (официальный сайт).
2. <https://www.nalog.gov.ru> - Федеральная налоговая служба (официальный сайт).
3. <https://roskazna.gov.ru/> - Федеральное казначейство (официальный сайт).
5. <https://cbr.ru/> - Центральный банк Российской Федерации (официальный сайт).
7. <https://sfr.gov.ru/> - Социальный фонд России (официальный сайт).
8. <https://www.ffoms.gov.ru> - Федеральный фонд обязательного медицинского страхования(официальный сайт).
10. <http://www.tfoms22.ru/> - Территориальный фонд обязательного медицинского страхования Алтайского края.
11. <https://econom22.ru/> - Министерство экономического развития Алтайского края
12. <https://www.altairegion22.ru/> - официальный сайт Алтайского края

13. <https://www.testfirm.ru/> - сайт проекта сравнительного анализа финансового состояния российских организаций

## **6.5 Иные источники**

Не предполагается.

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

Для обеспечения учебного процесса по Б1.О.03 «Эконометрика (продвинутый уровень)» филиал располагает учебными аудиториями для проведения занятий лекционного типа, практических занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещениями для самостоятельной работы и помещениями для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования.

В Системе онлайн-обучения Алтайского филиала РАНХиГС создан курс на базе платформы Moodle. Для доступа к курсу студенты проходят процедуру регистрации. В курсе отражены модули и темы с учебными материалами и ссылками на литературные источники.

Для реализации программы филиал обладает вычислительным телекоммуникационным оборудованием и лицензионными программными продуктами Microsoft Office (Excel, Word, Outlook, PowerPoint и др.) и другими материально-техническими ресурсами, необходимыми для реализации дисциплины, в том числе доступом к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам. На практических занятиях используется пакет SPSS Statistics – многофункциональная программа для решения исследовательских и бизнес-задач при помощи анализа данных.

Библиотека Алтайского филиала РАНХиГС имеет профильную библиографическую базу, оборудованный необходимой техникой читальный зал, имеет выход в Интернет.

Лекционные аудитории оснащены видеопроекторным оборудованием для проведения презентаций, а также средствами звуковоспроизведения; помещения для практических занятий укомплектованы учебной мебелью. Компьютеры во всех учебных аудиториях подключены к сети Интернет.

Студенты из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья обеспечены печатными и электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья.