

УТВЕРЖДЕНА

Решением Ученого совета
АНО ВО «Центральный
университет»
«24» июня 2025 г.
Протокол №2

**Рабочая программа дисциплины (модуля)
«Эконометрика»**

Направление подготовки: 38.03.05 Бизнес-информатика

Направленность (профиль) подготовки: Бизнес-аналитика

Квалификация (степень) выпускника: бакалавр

Форма обучения: очная

Срок освоения программы: 4 года

Год набора: 2025

**Москва
2025**

Содержание

| | |
|--|----------|
| 1. Краткая характеристика дисциплины (модуля) | 3 |
| 2. Перечень планируемых результатов обучения | 4 |
| 3. Тематический план | 5 |
| 4. Содержание дисциплины (модуля) | 5 |
| 5. Учебно-методическое обеспечение | 7 |
| 6. Материально-техническое обеспечение | 7 |
| 7. Методические и оценочные материалы | 9 |

1. Краткая характеристика дисциплины (модуля)

Рабочая программа дисциплины (модуля) «Эконометрика» составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – бакалавриат по специальности 38.03.05 Бизнес-информатика, профиль Бизнес-аналитика, утвержденный приказом Министерства науки и высшего образования Российской Федерации № 838 от 29.07.2020 года.

Изучение дисциплины (модуля) «Эконометрика» позволяет студентам применять статистические методы для анализа экономических данных, что способствует более точному пониманию экономических явлений и выявлению закономерностей. Это знание является ключевым для принятия обоснованных решений в бизнесе и государственной политике, а также для оценки эффективности различных экономических моделей.

Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Настоящая дисциплина (модуль) включена в учебный план по программе подготовки бакалавриата по направлению 38.03.05 Бизнес-информатика, профиль Бизнес-аналитика и входит в обязательную часть Блока 1, как дисциплина (модуль) по выбору.

Дисциплина (модуль) доступна для изучения на 2 или 3 курсе в 4 или 5 семестре на выбор.

Цель изучения дисциплины (модуля): формирование навыков применения статистических методов к экономическим данным для анализа, интерпретации и прогнозирования экономических процессов.

Задачи изучения дисциплины (модуля):

— освоить знания об основных типах эконометрических данных, основных эконометрических моделях для перекрестных данных, различных типах эконометрических проблем, которые возникают в перекрестных данных, а также о перечне их последствий и возможных решений;

— сформировать умения проверять статистические гипотезы, находить данные, необходимые для проведения эконометрического исследования.

В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен:

знать:

— основные типы эконометрических данных: перекрёстные, временные ряды, панельные данные;

— спецификацию и условия применения классической линейной модели регрессии для перекрёстных данных;

— основные проблемы, возникающие при оценивании моделей по перекрёстным данным (гетероскедастичность, мультиколлинеарность, автокорреляция), их последствия и способы устранения;

уметь:

— проводить проверку статистических гипотез в рамках регрессионного анализа;

— оценивать параметры эконометрических моделей с помощью метода наименьших квадратов (МНК) и интерпретировать полученные коэффициенты;

— находить, отбирать и подготавливать данные для проведения простого эконометрического исследования;

— выявлять наличие типичных эконометрических проблем в моделях и применять базовые подходы к их диагностике;

владеть:

— навыками построения и интерпретации простых эконометрических моделей на основе реальных данных;

— базовыми приёмами работы с данными и критического анализа качества эконометрической модели.

2. Перечень планируемых результатов обучения

Компетенции, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля) при проведении учебных занятий в форме контактной работы обучающихся с педагогическими работниками Университета и в форме самостоятельной работы обучающихся:

| Компетенция | Содержание компетенции | Индикатор компетенции | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю) |
|-------------|--|-----------------------|--|
| ПК-1. | Способен использовать основные методы естественнонаучных, экономических и ИТ-дисциплин в профессиональной деятельности для теоретического и экспериментального исследования | ПК-1.1. | Знает ключевые методы естественнонаучных, экономических и ИТ-дисциплин, применяемые в профессиональной деятельности |
| | | ПК-1.2. | Умеет интегрировать различные методологические подходы для проведения теоретических и экспериментальных исследований |
| | | ПК-1.3. | Имеет практический опыт применения методов в реальных проектах для достижения научных и практических результатов |
| ПК-2. | Способен использовать соответствующий математический аппарат и инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования для решения задач профессиональной деятельности | ПК-2.1. | Знает основные математические методы и инструментальные средства, применяемые для обработки и анализа информации |
| | | ПК-2.2. | Умеет эффективно использовать математический аппарат для систематизации данных и решения профессиональных задач |
| | | ПК-2.3. | Имеет практический опыт работы с инструментами анализа информации в рамках исследовательских проектов |

3. Тематический план

| № п/п | Наименование раздела дисциплины (модуля) | Трудоемкость, академические часы | | | | | ТКУ (текущий контроль успеваемости) |
|----------|--|----------------------------------|-----------|-----------|----------|-------------------------------|--|
| | | Очная форма | | | | | |
| | | Контактная работа | | | Контроль | Самостоя тельная работа | |
| Лекции | Семинарские | Консультации | | | | | |
| 1 | Математическая статистика | 6 | 6 | 4 | | 20 | Домашние задания |
| 2 | Классическая модель множественной регрессии | 6 | 6 | 4 | 4 | 21 | Домашние задания, Контрольная работа |
| 3 | Отклонение от предпосылок теоремы Гаусса-Маркова | 6 | 6 | 4 | | 21 | Домашние задания |
| 4 | Эффекты воздействия | 6 | 6 | 4 | | 20 | Домашние задания |
| 5 | Модели с качественными зависимыми переменными | 6 | 6 | 4 | | 20 | Домашние задания, Проект |
| | <i>Экзамен</i> | | | | 4 | | |
| | <i>Итого:</i> | <i>30</i> | <i>30</i> | <i>20</i> | <i>8</i> | <i>102</i> | |
| | <i>Объем дисциплины (модуля) (в ак. ч.)</i> | <i>190</i> | | | | | |
| | <i>Объем дисциплины (модуля) (в зач. ед.)</i> | <i>5</i> | | | | | |

4. Содержание дисциплины (модуля)

| № п/п | Наименование раздела дисциплины (модуля) | Содержание дисциплины (модуля) по темам |
|----------|--|--|
| 1 | Математическая статистика | Методы получения оценок: метод максимального правдоподобия, метод моментов, метод наименьших квадратов. Свойства оценок: несмещённость, состоятельность, эффективность в классе. Центральная предельная теорема. Лемма Слуцкого. Дельта-метод. Построение асимптотических доверительных интервалов. Три классических теста: LM, LR, Wald. |
| 2 | Классическая модель множественной регрессии | МНК в скалярной и матричной форме без статистических свойств. Строгая мультиколлинеарность. МНК со статистическими предпосылками на ожидание и дисперсию. Теорема Гаусса-Маркова. Пропущенные и лишние переменные модели. Построение доверительных интервалов для МНК оценок. Проверка гипотез. Асимптотика без нормальности ошибок. Нормальность ошибок. |
| 3 | Отклонение от предпосылок теоремы Гаусса-Маркова | Бутстрэп. Классический бутстрэп до регрессии и бутстрэп в регрессии. Метод наименьших модулей. Дамми-переменные и их интерпретация. Функциональные формы: полиномы, логарифмы, интерпретация коэффициентов. Информационные критерии. Гетероскедастичность. Тестирование гетероскедастичности. Робастные оценки. Доступный обобщённый МНК. Мультиколлинеарность и метод главных |

| | | |
|---|---|---|
| | | компонент. Эндогенность. Инструментальные переменные. Ошибка измерения регрессора. Двухшаговый МНК. |
| 4 | Эффекты воздействия | Оценка эффектов воздействия. АТЕ. LATE. Четкий (sharp) и нечеткий (fuzzy) разрывный регрессионный дизайн (RDD). |
| 5 | Модели с качественными зависимыми переменными | Логистическая регрессия: Бинарный и упорядоченный логит. Точечные оценки, прогнозы. Интерпретация предельных эффектов. Логистическая регрессия: доверительные интервалы и проверка гипотез. |

5. Учебно-методическое обеспечение

Университет располагает полным набором лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, включая продукты отечественного производства.

Каждый студент в течение всего периода обучения получает индивидуальный неограниченный доступ к электронно-библиотечной системе и электронной информационно-образовательной среде университета. Эти системы предоставляют возможность доступа к ресурсам из любой точки, где есть подключение к сети Интернет, как на территории университета, так и за его пределами.

Студентам обеспечен удаленный доступ к современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам.

Основная литература:

1. Демидова, О. А. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / О. А. Демидова, Д. И. Малахов. — 2-е изд., перераб. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 398 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-20392-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/560504>.

2. Эконометрика : учебник для вузов / под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/559612>.

3. Кремер, Н. Ш. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; под редакцией Н. Ш. Кремера. — 4-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 308 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-08710-9. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/559689>.

4. Евсеев, Е. А. Эконометрика : учебник для вузов / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 186 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10752-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/563094>.

5. Костюнин, В. И. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / В. И. Костюнин. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 285 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-02660-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/560240>.

Дополнительная литература:

1. Евсеев, Е. А. Эконометрика : учебник для вузов / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 186 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10752-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/563094>.

6. Материально-техническое обеспечение

Университет располагает материально-технической базой, соответствующей действующим противопожарным правилам и нормам и обеспечивающей проведение всех видов дисциплинарной и междисциплинарной подготовки, практической и научно-исследовательской работ обучающихся, предусмотренных учебным планом.

Помещения, которые представляют собой учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского (практического) типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, а также помещения для самостоятельной работы и помещения для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования. Помещения укомплектованы специализированной

мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Изучение дисциплины (модуля) обеспечивается в учебных аудиториях, оснащенных:

- столами и стульями;
- компьютерной техникой;
- механическими калькуляторами;
- специализированным оборудованием, включая демонстрационное оборудование.

Помещения для самостоятельной работы обучающихся, в том числе приспособленные для использования инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья, оснащены компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Университета.

Обучающимся предоставляется доступ (в том числе удаленный) к ресурсам информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», электронным ресурсам (в том числе электронным библиотечным системам, современным профессиональным базам данных и информационным справочным системам):

| № | Наименование портала (издания, курса, документа) | Ссылка |
|---|--|---|
| 1 | Библиотека электронных ресурсов исторического факультета МГУ | http://www.hist.msu.ru/ER/index.html |
| 2 | Государственная публичная историческая библиотека России | https://www.shpl.ru/ |
| 3 | Научная электронная библиотека elibrary.ru библиотека | https://elibrary.ru/defaultx.asp |
| 4 | База данных ScienceDirect | https://www.sciencedirect.com |
| 5 | Официальный сайт Министерства науки и высшего образования Российской Федерации | https://minobrnauki.gov.ru/ |
| 6 | Федеральный портал «Российское образование» | https://www.edu.ru/ |
| 7 | Информационная система "Единое окно доступа к образовательным ресурсам" | http://window.edu.ru/ |
| 8 | Единая коллекция цифровых образовательных ресурсов | http://school-collection.edu.ru/ |
| 9 | Федеральный центр информационно - образовательных ресурсов | http://fcior.edu.ru/ |

Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), в том числе комплект лицензионного программного обеспечения, современные профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

| Наименование ПО | Производство | Лицензионное / свободно распространяемое |
|--|---------------|--|
| Операционные системы: | | |
| Microsoft Imagine (Windows Client, Server) | зарубежное | лицензионное |
| Браузеры: | | |
| Яндекс.Браузер | отечественное | свободно распространяемое |
| Google Chrome | зарубежное | свободно распространяемое |
| Офисные приложения: | | |
| Microsoft Imagine (Visio, OneNote) | зарубежное | лицензионное |
| TeXstudio | зарубежное | свободно распространяемое |
| Adobe Acrobat Reader | зарубежное | свободно распространяемое |
| Программное обеспечение для планирования и учета времени: | | |
| Toggle app | зарубежное | свободно распространяемое |
| Системы управления проектами: | | |

| | | |
|---|---------------|---------------------------|
| Microsoft Imagine (Project) | зарубежное | лицензионное |
| Системы управления базами данных: | | |
| Microsoft Imagine (SQL Server) | зарубежное | лицензионное |
| Системы резервного копирования (backup): | | |
| Acronis Backup Advanced for HyperV | зарубежное | лицензионное |
| Справочно-правовые системы: | | |
| КонсультантПлюс: справочно-правовая система | отечественное | лицензионное |
| Средства антивирусной защиты: | | |
| Kaspersky Endpoint Security для бизнеса Стандартный Russian Edition | отечественное | лицензионное |
| Пакеты программных средств и библиотек: | | |
| AutoPsy | зарубежное | свободно распространяемое |
| Interactive Disassembler (IDA) | зарубежное | свободно распространяемое |
| Системы управления библиографической информацией: | | |
| Zotero | зарубежное | свободно распространяемое |
| Сервисы и службы: | | |
| Bind | зарубежное | свободно распространяемое |
| Docker | зарубежное | свободно распространяемое |

7. Методические и оценочные материалы

Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

В процессе изучения дисциплины (модуля) «Эконометрика» в рамках текущего контроля успеваемости используются такие виды учебной работы, как лекции, семинары, консультации, домашние задания, контрольная работа, проект, а также различные виды самостоятельной работы обучающихся по заданию преподавателя, направленные на развитие навыков профессиональной лексики, закрепление практических профессиональных компетенций, поощрение инициатив.

Лекция – систематическое, последовательное, монологическое изложение преподавателем учебного материала, как правило, теоретического характера.

В процессе лекций рекомендуется вести конспект лекций: кратко и схематично фиксировать основные идеи, выводы и обобщения лекции; выделять важные мысли, ключевые слова и термины. Необходимо отметить вопросы или материалы, которые вызывают затруднения, и попытаться найти ответы в рекомендованной литературе. Если разобраться в материале не удастся, следует сформулировать вопрос и задать его преподавателю на консультации или во время семинарского (практического) занятия.

Участие в семинаре – активная работа студента на семинаре, его ответы на вопросы преподавателя и участие в дискуссии.

Для успешного участия в семинаре студентам рекомендуется заранее ознакомиться с темой обсуждения, прочитать необходимые материалы и подготовить вопросы. Важно активно слушать и вовлекаться в дискуссию, высказывая свои мнения и аргументируя их. При ответах на вопросы преподавателя стоит быть уверенным, четким и логичным, опираясь на изученный материал. Также полезно поддерживать диалог с однокурсниками, чтобы обогатить обсуждение и расширить свои знания.

Консультации – структурированные встречи, на которых преподаватели предоставляют индивидуальную или групповую помощь в освоении учебного материала, обсуждении вопросов и решении проблем, возникающих в процессе обучения.

Консультации могут включать разъяснение сложных тем, подготовку к экзаменам и помощь в выполнении курсовых работ, что способствует более глубокому пониманию предмета и улучшению академической успеваемости.

Домашнее задание – набор заданий по темам недели.

При работе над домашними заданиями важно внимательно ознакомиться с требованиями и сроками выполнения. Рекомендуется разбивать задания на этапы, чтобы избежать перегрузки и лучше усвоить материал. Использовать различные источники информации, включая учебники и онлайн-ресурсы, для более глубокого понимания темы.

Проект – исследовательская работа по курсу и презентация результатов.

Для успешной подготовки к проекту: четко определите цели и задачи проекта, распределите роли и обязанности между участниками, а также установите сроки выполнения каждой части работы. Регулярно проводите встречи для обсуждения прогресса и решения возникающих вопросов.

Контрольная работа – письменная работа с набором задач, которые нужно решить за ограниченное время.

Цель контрольной работы – получить специальные знания по одной или нескольким темам дисциплины (модуля) и продемонстрировать навыки их практического применения.

Самостоятельная работа – работа студентов, направленная на углубленное изучение отдельных тем и вопросов учебной дисциплины (модуля).

В процессе самостоятельной работы студенты взаимодействуют с рекомендованными материалами при минимальном участии преподавателя. Задачи студента включают работу с конспектами лекций (обработка текста), повторное изучение учебных материалов планов и тезисов ответов, изучение дополнительных тем, выполнение учебно-исследовательских заданий и другое.

Система оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю)

Критерии получения уровня и оценивания сформированности компетенций по дисциплине (модулю) «Эконометрика».

Оценивание уровня учебных достижений, обучающихся по дисциплине (модулю), осуществляется в виде текущего контроля успеваемости.

Промежуточная аттестация по дисциплине (модулю) осуществляется в форме **экзамена**, при этом проводится оценка компетенций, сформированных по дисциплине.

Для оценивания текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации используется десятибалльная шкала оценивания, которая соотносится с традиционной пятибалльной шкалой следующим образом:

| Десятибалльная оценка | Пятибалльная оценка | Общая характеристика результата обучения по дисциплине (модулю) |
|------------------------------|----------------------------|---|
| 10 | Отлично | Студент полностью владеет знаниями, изложенными в рабочей программе, и глубоко осмысляет дисциплину. Он самостоятельно и логически последовательно отвечает на все вопросы, акцентируя внимание на наиболее важном. Умеет анализировать, сравнивать, классифицировать, обобщать, конкретизировать и систематизировать изученный материал, выделяя ключевые моменты и устанавливая причинно-следственные связи. Четко формулирует ответы, уверенно интерпретирует результаты анализов и других исследований, а также решает сложные задачи. Студент хорошо знаком с методами исследования, необходимыми для практической деятельности, и умеет связывать теоретические аспекты |
| 9 | Отлично | |
| 8 | Отлично | |

| Десятибалльная оценка | Пятибалльная оценка | Общая характеристика результата обучения по дисциплине (модулю) |
|-----------------------|---------------------|--|
| | | дисциплины (модуля) с практическими задачами. |
| 7 | Хорошо | Студент обладает знаниями предмета почти в полном объеме рабочей программы и самостоятельно, логически последовательно и всесторонне отвечает на все вопросы, акцентируя внимание на наиболее значимых моментах. Он умеет анализировать, сравнивать, классифицировать, обобщать, конкретизировать и систематизировать изученный материал, выделяя его ключевые аспекты и устанавливая причинно-следственные связи. Формулирует свои ответы, уверенно интерпретирует результаты анализов и других исследований, а также решает сложные ситуационные задачи. Студент хорошо знаком с методами исследования, необходимыми для практической деятельности, и умеет связывать теоретические аспекты предмета с практическими задачами. |
| 6 | Хорошо | |
| 5 | Удовлетворительно | Студент обладает базовыми знаниями по дисциплине, но испытывает трудности при самостоятельных ответах и использует неточные формулировки. В ходе ответов он допускает ошибки, касающиеся сути вопросов. Студент способен решать только самые простые задачи и владеет лишь минимальным набором методов исследования. |
| 4 | Удовлетворительно | |
| 3 | Не сдан | Студент не овладел обязательным минимумом знаний по предмету и не может ответить на вопросы, даже если преподаватель задает дополнительные наводящие вопросы. |
| 2 | Не сдан | |
| 1 | Не сдан | |

Дисциплина (модуль) «Эконометрика» оценивается следующим образом:

| Активность | Вес | Количество | Описание |
|--------------------|-----|------------|--|
| Домашние задания | 20% | 13 | Набор задач по темам недели |
| Проект | 20% | 7 | Защита проектов |
| Контрольная работа | 30% | 1 | Письменная работа с набором задач, которые нужно решить за ограниченное время |
| Экзамен | 30% | 1 | Письменная или устная работа над заданием, направленным на проверку полученных знаний и навыков по дисциплине (модулю) |

Формула расчёта итоговой оценки по дисциплине (модулю) «Эконометрика»:
« $0,2 \times$ среднее за домашние задания + $0,2 \times$ среднее за проект + $0,3 \times$ контрольная работа + $0,3 \times$ экзамен».

Текущий контроль успеваемости обучающихся по дисциплине (модулю)

Примерные домашние задания

Домашнее задание по теме: «Методы получения оценок: метод максимального правдоподобия, метод моментов, метод наименьших квадратов»

Задание 1.

Рассмотрите выборку из n независимых наблюдений, распределённых по

нормальному закону с неизвестными параметрами μ и σ^2 . Напишите функцию правдоподобия и найдите оценки параметров μ и σ^2 с использованием метода максимального правдоподобия.

Задание 2.

Для случайной величины X , имеющей экспоненциальное распределение с параметром λ , найдите метод моментов для оценки параметра λ на основе выборки из n наблюдений. Вычислите оценку и проиллюстрируйте её на примере.

Задание 3.

Рассмотрите выборку из n независимых наблюдений, распределённых по биномиальному закону с параметрами n и p . Найдите оценки для параметров n и p с использованием метода максимального правдоподобия.

Задание 4.

Для нормального распределения с параметрами μ и σ^2 найдите оценки параметров с использованием метода моментов. Сравните эти оценки с оценками, полученными методом максимального правдоподобия.

Задание 5.

Найдите реальный набор данных, который можно проанализировать с помощью линейной регрессии. Примените метод наименьших квадратов для оценки параметров модели, а затем оцените качество модели, используя критерии, такие как R-квадрат и стандартная ошибка.

Домашние задания по теме: «МНК в скалярной и матричной форме без статистических свойств. Строгая мультиколлинеарность»

Задание 1.

Постройте модель линейной регрессии с высокой мультиколлинеарностью между независимыми переменными. Проанализируйте, как это влияет на оценки коэффициентов и их стандартные ошибки.

Задание 2.

Рассмотрите модель с мультиколлинеарностью. Попробуйте устранить её, удалив одну из коррелирующих переменных. Сравните результаты до и после удаления переменной.

Задание 3.

Постройте полиномиальную регрессионную модель $Y = \beta_0 + \beta_1 X + \beta_2 X^2 + \epsilon$. Выведите оценки параметров с использованием метода наименьших квадратов в скалярной и матричной формах.

Задание 4.

Используя набор данных, проверьте предположения метода наименьших квадратов: линейность, независимость, гомоскедастичность и нормальность остатков. Объясните, как вы это сделали и какие выводы сделали.

Задание 5.

Найдите реальный набор данных и примените метод наименьших квадратов для оценки параметров модели. Проанализируйте результаты и сделайте выводы о качестве модели.

Домашнее задание по теме: «Бутстрэп. Классический бутстрэп до регрессии и бутстрэп в регрессии. Метод наименьших модулей»

Задание 1.

Объясните, что такое классический бутстрэп и как он используется для оценки параметров выборки. Напишите небольшую программу на Python или R, которая реализует классический бутстрэп для оценки среднего значения и стандартного отклонения на произвольном наборе данных. Визуализируйте результаты с помощью графиков.

Задание 2.

Используя метод бутстрапа, постройте 95% доверительный интервал для медианы

выборки. Объясните, как вы выбирали количество бутстрэп-выборок и как интерпретировать полученные результаты. Сравните этот интервал с доверительным интервалом, полученным с использованием классических методов.

Задание 3.

Реализуйте бутстрэп для оценки коэффициентов линейной регрессионной модели. Используйте произвольный набор данных и постройте модель, оцените коэффициенты с помощью бутстрапа и сравните их с коэффициентами, полученными методом наименьших квадратов. Обсудите, как изменяются стандартные ошибки коэффициентов.

Задание 4.

Объясните, что такое метод наименьших модулей и в чем его преимущества по сравнению с методом наименьших квадратов. Примените метод наименьших модулей к набору данных с выбросами и сравните результаты с методом наименьших квадратов. Обсудите, как выбросы влияют на оценки.

Задание 5.

Выберите набор данных и примените как классический бутстрэп, так и метод наименьших модулей для оценки параметров (например, среднее, медиана, коэффициенты регрессии). Сравните результаты и сделайте выводы о том, какой метод дает более надежные оценки в зависимости от свойств данных (например, наличия выбросов, распределения и т.д.).

Домашнее задание по теме: «Оценка эффектов воздействия. ATE. LATE.

Четкий (sharp) и нечеткий (fuzzy) разрывный регрессионный дизайн (RDD)»

Задание 1.

Опишите понятия ATE (Average Treatment Effect) и LATE (Local Average Treatment Effect). Объясните, как они различаются и в каких ситуациях каждый из них может быть использован. Приведите примеры из литературы или реальных исследований.

Задание 2.

Найдите исследование, в котором использовался четкий разрывной регрессионный дизайн (sharp RDD). Опишите, как исследователи определяли разрыв и какие методы использовались для оценки эффекта. Проанализируйте, какие результаты были получены и как они интерпретируются.

Задание 3.

Изучите концепцию нечеткого разрывного регрессионного дизайна (fuzzy RDD). Приведите пример, когда нечеткий RDD может быть более подходящим, чем четкий. Объясните, как можно оценить эффект воздействия в этом контексте и какие статистические методы могут быть использованы.

Задание 4.

Выберите набор данных, в котором можно применить как четкий, так и нечеткий RDD. Проведите анализ, используя оба метода, и сравните результаты. Обсудите, как различия в подходах влияют на интерпретацию эффектов воздействия.

Задание 5.

Разработайте исследовательский проект, в котором вы будете оценивать ATE и LATE для конкретного вмешательства (например, образовательной программы, медицинского лечения и т.д.). Опишите методологию, которую вы будете использовать, включая выбор данных, методы оценки и возможные ограничения. Подготовьте краткий отчет о ваших находках и выводах.

Домашнее задание по теме: «Логистическая регрессия: Бинарный и упорядоченный логит. Точечные оценки, прогнозы. Интерпретация предельных эффектов»

Задание 1.

Объясните, что такое бинарная логистическая регрессия. Опишите, как она используется для моделирования зависимой переменной, принимающей два значения (например, успех/неудача). Приведите пример реального исследования, в котором

использовалась бинарная логистическая регрессия, и проанализируйте результаты.

Задание 2.

Опишите, что такое упорядоченный логит и когда его следует использовать. Приведите пример ситуации, где зависимая переменная имеет более двух категорий, и объясните, как упорядоченный логит помогает в анализе данных. Обсудите, как интерпретируются коэффициенты в этой модели.

Задание 3.

Используя набор данных, выполните бинарную логистическую регрессию и получите точечные оценки для коэффициентов модели. Объясните, как вы интерпретируете эти коэффициенты. Затем сделайте прогнозы для нескольких наблюдений и оцените, насколько точны ваши прогнозы по сравнению с фактическими значениями.

Задание 4.

Проведите анализ предельных эффектов для модели бинарной логистической регрессии, которую вы построили в предыдущем задании. Объясните, что такое предельные эффекты и как они помогают в интерпретации результатов. Приведите примеры, показывающие, как изменение независимых переменных влияет на вероятность наступления события.

Задание 5.

Сравните бинарную логистическую регрессию и упорядоченный логит на одном и том же наборе данных. Объясните, в каких случаях одна модель может быть предпочтительнее другой. Проведите анализ, используя обе модели, и сравните их результаты, включая точечные оценки и предельные эффекты. Напишите отчет о ваших находках и выводах.

Примерные задания для проекта

Примерное описание и критерии оценивания к проекту

Цель проекта:

Провести институциональный анализ выбранного экономического процесса или организации, выявить влияние формальных и неформальных институтов, оценить транзакционные издержки, предложить рекомендации по оптимизации институциональной среды.

Требования к содержанию:

1. **Введение** – обоснование выбора кейса, актуальность, цели и задачи исследования.
2. **Теоретическая часть** – объяснение ключевых институциональных концепций, связанных с кейсом.
3. **Аналитическая часть** – применение институционального подхода к выбранному кейсу:
 - Анализ формальных и неформальных правил.
 - Оценка транзакционных издержек.
 - Выявление роли информации, доверия и репутации.
 - Исследование возможных институциональных ловушек.
4. **Рекомендации** – предложения по улучшению институциональной среды на основе проведенного анализа.
5. **Заключение** – выводы о значимости институциональных факторов в рассматриваемом кейсе.

Форма представления:

- Письменный отчет (10–15 стр.) в научном стиле.
- Презентация (10–12 слайдов) с ключевыми выводами.
- Возможна защита проекта (устное выступление 7–10 мин.).

Критерии оценивания:

1. **Глубина анализа**
 - Применение институциональных теорий к кейсу.

- Выявление роли институтов, транзакционных издержек, информационной асимметрии.
- 2. **Научная обоснованность**
 - Использование актуальных источников (учебники, статьи, данные).
 - Корректное применение терминологии.
- 3. **Практическая значимость**
 - Релевантность рекомендаций для реальной экономики.
 - Возможность применения выводов в бизнесе или госполитике.
- 4. **Логика и структура работы**
 - Четкость изложения, отсутствие противоречий.
 - Соответствие структуры научным стандартам.
- 5. **Оформление и презентация**
 - Грамотность, соблюдение формата.
 - Наглядность и убедительность презентации (если предусмотрена).

Примерные задания для контрольной работы

Задание 1.

Объясните, в чем заключается метод максимального правдоподобия (ММП) и приведите пример его применения. Каковы его основные преимущества по сравнению с другими методами?

Задание 2.

Определите несмещённость, состоятельность и эффективность оценок. Приведите примеры оценок, которые удовлетворяют каждому из этих свойств.

Задание 3.

Формулируйте центральную предельную теорему (ЦПТ) и объясните, как она применяется в статистике. Каковы её основные условия?

Задание 4.

Объясните суть леммы Слуцкого. Как она используется для доказательства свойств асимптотических распределений оценок?

Задание 5.

Опишите дельта-метод и его применение в статистике. Как он позволяет находить асимптотические распределения функций оценок?

Задание 6.

Сравните тесты LM, LR и Wald. В чем заключаются их основные отличия, и в каких случаях каждый из них предпочтителен?

Задание 7.

Приведите формулы для метода наименьших квадратов (МНК) в скалярной и матричной формах. Как они отличаются друг от друга?

Задание 8.

Что такое строгая мультиколлинеарность? Как она влияет на оценку коэффициентов в модели линейной регрессии?

Задание 9.

Сформулируйте теорему Гаусса-Маркова и объясните, почему она важна для метода наименьших квадратов. Какие условия должны быть выполнены для её применения?

Задание 10.

Объясните, как проводится проверка гипотез в контексте линейной регрессии. Каковы последствия, если ошибки модели не подчиняются нормальному распределению, и какие методы можно использовать для решения этой проблемы?

Задания для промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)

| № п/п | Задание | Ответ | Компетенция |
|-------|--|--|-------------|
| 1 | Укажите метод получения оценок параметров в математической статистике. | Метод максимального правдоподобия (ММП) | ПК-1 |
| 2 | Укажите свойство оценки, означающее стремление к истинному значению при увеличении выборки. | Состоятельность | ПК-2 |
| 3 | Укажите теорему, описывающую асимптотическую нормальность суммы независимых случайных величин. | Центральная предельная теорема | ПК-2 |
| 4 | Укажите тест для проверки гипотез в эконометрических моделях. | Wald тест | ПК-2 |
| 5 | Укажите метод оценки коэффициентов в множественной регрессии. | Метод наименьших квадратов (МНК) | ПК-2 |
| 6 | Укажите проблему в регрессионной модели при высокой корреляции регрессоров. | Мультиколлинеарность | ПК-1 |
| 7 | Укажите теорему, гарантирующую эффективность МНК при соблюдении предпосылок. | Теорема Гаусса-Маркова | ПК-1 |
| 8 | Укажите метод обработки отклонений от предпосылок в регрессии. | Бутстрэп | ПК-1 |
| 9 | Укажите способ учета качественных переменных в регрессионной модели. | Дамми-переменные | ПК-1 |
| 10 | Укажите метод коррекции гетероскедастичности в регрессии. | Обобщённый метод наименьших квадратов (ОМНК) | ПК-1 |
| 11 | Укажите инструмент для построения асимптотических доверительных интервалов. | Дельта-метод | ПК-2 |
| 12 | Укажите лемму, используемую для асимптотического анализа оценок. | Лемма Слуцкого | ПК-2 |
| 13 | Укажите метод решения проблемы эндогенности в регрессии. | Инструментальные переменные | ПК-2 |
| 14 | Укажите критерий для выбора функциональной формы модели. | Информационные критерии (AIC, BIC) | ПК-2 |
| 15 | Укажите метод анализа чувствительности модели к изменениям параметров. | Сценарный анализ | ПК-2 |
| 16 | Укажите формат представления результатов проверки гипотез в отчете. | Таблица с p-значениями | ПК-1 |
| 17 | Укажите стандарт оформления научно-технического отчета по эконометрическому исследованию. | ГОСТ Р 7.0.11-2011 | ПК-1 |

| | | | |
|----|--|--|------|
| 18 | Укажите элемент презентации результатов регрессионного анализа. | Графики остатков | ПК-1 |
| 19 | Укажите способ структурирования научной публикации по результатам моделирования. | Введение, методы, результаты, заключение | ПК-1 |
| 20 | Укажите инструмент для визуализации доверительных интервалов в отчете. | Диаграмма с ошибками | ПК-2 |