МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

Учебно-методическое объединение по образованию в области управления

**УТВЕ9РЖДЕНО**

Первым заместителем Министра

образования Республики Беларусь

А.Г.Бахановичем

**30.07.2024**

Регистрационный **№ 6-05-04-040/пр.**

**МАТЕМАТИЧЕСКАЯ СТАТИСТИКА И ЭКОНОМЕТРИКА**

**Примерная учебная программа по учебной дисциплине**

**для специальности:**

6-05-0414-03 «Государственное управление и экономика»

|  |  |
| --- | --- |
| СОГЛАСОВАНО\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | СОГЛАСОВАНОНачальник Главного управленияпрофессионального образованияМинистерства образованияРеспублики Беларусь\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ С.Н.Пищов\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
| СОГЛАСОВАНОПредседатель учебно-методического объединения по образованию в области управления\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ В.В.Данилович\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ | СОГЛАСОВАНОПроректор по научно-методическойработе Государственного учрежденияобразования «Республиканскийинститут высшей школы»\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ И.В.Титович\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |
|  | Эксперт-нормоконтролер\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ М.М. Байдун\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ |

Минск 2024

**СОСТАВИТЕЛИ:**

О.Б.Плющ, доцент кафедры управления информационными ресурсами Института управленческих кадров Академии управления при Президенте Республики Беларусь, кандидат физико-математических наук, доцент;

В.К.Шешолко, доцент кафедры управления информационными ресурсами Института управленческих кадров Академии управления при Президенте Республики Беларусь, кандидат физико-математических наук, доцент.

**РЕЦЕНЗЕНТЫ:**

В.А.Иванюкович, доцент кафедры информационных технологий в экологии и медицине учреждения образования «Международный экологический институт имени А.Д. Сахарова» БГУ, канд. физ.-матем. наук, доцент;

Кафедра программной инженерии факультета информационных технологий учреждения образования Белорусский государственный технологический университет (протокол № 6 от 28.12.2023).

**РЕКОМЕНДОВАНА К УТВЕРЖДЕНИЮ В КАЧЕСТВЕ ПРИМЕРНОЙ:**

Кафедрой управления информационными ресурсами Института управленческих кадров Академии управления при Президенте Республики Беларусь

(протокол № 14 от 06.12.2023);

Научно-методическим советом Академии управления при Президенте Республики Беларусь

(протокол № 6 от 22.02.2024);

Научно-методическим советом по государственному управлению учебно-методического объединения по образованию в области управления

(протокол № 4 от 15.03.2024).

Ответственный за редакцию: В.К. Шешолко

Ответственный за выпуск: В.К. Шешолко

**I. ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА**

Примерная учебная программа по учебной дисциплине «Математическая статистика и эконометрика» разработана для учреждений высшего образования в соответствии с требованиями образовательного стандарта общего высшего образования по специальности 6-05-0414-03 «Государственное управление и экономика» и примерного учебного плана по указанной специальности.

*Целью изучения учебной дисциплины* «Математическая статистика и эконометрика» является практическое использование обучающимися эконометрических методов и моделей в конкретных областях экономических исследований на основе использования современных статистических и эконометрических методов и вычислительной техники.

*Основными задачами учебной дисциплины являются:*

знакомство с современным представлением об эконометрике;

овладение основными приемами выборочных исследований;

овладение приемами практического анализа временных рядов;

 овладение методами построения и анализа одновременных эконометрических уравнений;

 Учебная дисциплина «Математическая статистика и эконометрика» является составной частью модуля «Математический» государственного компонента.

 Учебная программа составлена с учетом межпредметных связей с учебной дисциплиной «Высшая математика».

Изучение учебной дисциплины «Математическая статистика и эконометрика» направлено на формирование у студентов **универсальной компетенции**: решать стандартные задачи профессиональной деятельности на основе применения информационно-коммуникационных технологий и **базовой профессиональной компетенции:** использовать прикладные методы математической статистики и эконометрики для анализа, оценки результатов профессиональной деятельности и построения эконометрических моделей;

В результате освоения учебной дисциплины «Математическая статистика и эконометрика» обучающийся должен:

*знать:*

основные понятия эконометрического моделирования и виды моделей;

алгоритмы построения и анализа эконометрических моделей;

основы эконометрического анализа статических и динамических моделей между экономическими переменными;

методы решения оптимизационных задач в экономической области;

основные методы обнаружения и устранения мультиколлинеарности, автокорреляции и гетероскедастичности эконометрических моделей;

*уметь:*

решать экономические задачи с использованием методов эконометрики;

самостоятельно проводить идентификацию эконометрических моделей;

проводить анализ и обработку данных;

строить эконометрические модели;

 анализировать результаты моделирования и делать экономически обоснованные выводы;

 использовать основные модели для анализа и прогноза результатов экономической деятельности;

*владеть:*

 навыками эконометрического анализа задач сферы экономики и управления;

 навыками построения регрессионных уравнений для экономических процессов и систем;

 методами спецификации эконометрических моделей;

 методами проведения прогнозных расчетов показателей на основе регрессионных моделей.

В рамках образовательного процесса по данной учебной дисциплине студент должен приобрести не только теоретические и практические знания, умения и навыки по специальности, но и развить свой ценностно-личностный, духовный потенциал, сформировать качества патриота и гражданина, готового к активному участию в экономической, производственной, социально-культурной и общественной жизни страны.

Всего на изучение учебной дисциплины «Математическая статистика и эконометрика» отведено 200 часов, в том числе 100 аудиторных часов.

Примерное распределение аудиторных часов по видам занятий: лекции – 50 часов, лабораторные занятия – 32 часа, практические занятия – 10 часов, семинарские занятия – 8 часов.

Рекомендуемые формы промежуточной аттестации – зачет, экзамен.

**ПРИМЕРНЫЙ ТЕМАТИЧЕСКИЙ ПЛАН**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| №п/п | Название раздела, темы | Количество часов аудиторных занятий  |
| Всего | Лекции | Практическиезанятия | Лабораторныезанятия  | Семинарскиезанятия |
| 1 | Функция распределения дискретных и непрерывных случайных величин | 8 | 4 | 4 |  |  |
| 2 | Основные законы распределения случайных величин | 8 | 4 | 2 |  | 2 |
| 3 | Основные понятия математической статистики | 8 | 2 | 2 | 2 | 2 |
| 4 | Доверительные интервалы для математического ожидания и среднего квадратического отклонения | 6 | 4 |  |  | 2 |
| 5 | Проверка статистических гипотез | 6 | 2 |  | 2 | 2 |
| 6 | Многомерные случайные величины | 6 | 4 |  | 2 |  |
| 7 | Основные понятия корреляционно-регрессионного анализа | 6 | 2 | 2 | 2 |  |
| 8 | Основные понятия, предмет и область применения эконометрики | 2 | 2 |  |  |  |
| 9 | Парная регрессия и корреляция | 6 | 4 |  | 2 |  |
| 10 | Модели множественной линейной регрессии | 4 | 2 |  | 2 |  |
| 11 | Спецификация эконометрической модели | 4 | 2 |  | 2 |  |
| 12 | Эконометрический анализ при нарушении классических модельных предположений | 6 | 2 |  | 4 |  |
| 13 | Модели с фиктивными (дихотомическими) переменными | 4 | 2 |  | 2 |  |
| 14 | Моделирование временных рядов | 4 | 2 |  | 2 |  |
| 15 | Динамические эконометрические модели | 12 | 6 |  | 6 |  |
| 16 | Система одновременных эконометрических уравнений (СЭУ) | 10 | 6 |  | 4 |  |
| Итого: | 100 | 50 | 10 | 32 | 8 |

**СОДЕРЖАНИЕ УЧЕБНОГО МАТЕРИАЛА**

**Тема 1. Функция распределения дискретных и непрерывных случайных величин**

Случайная величина и закон ее распределения. Функция распределения случайной величины. Плотность распределения вероятностей непрерывных случайных величин.

Математическое ожидание, дисперсия и среднее квадратическое отклонение случайной величины.

Использование понятий математического ожидания и дисперсии в менеджменте.

**Тема 2. Основные законы распределения случайных величин**

Основные распределения случайных величин. Законы распределения дискретных случайных величин. Плотности и функции распределения непрерывных случайных величин.

Нормальное распределение. Вероятность попадания нормальной случайной величины в заданный интервал.

Вероятность отклонения случайной величины от ее математического ожидания.

**Тема 3. Основные понятия математической статистики**

Выборочный метод. Вариационный ряд. Графическое представление результатов статистического анализа.

Эмпирическая функция распределения. Важнейшие свойства статистических оценок. Надежность и доверительный интервал.

**Тема 4. Доверительные интервалы для математического ожидания и среднего квадратического отклонения**

Статистические оценки. Доверительные интервалы для математического ожидания при известной и неизвестной дисперсии.

Доверительный интервал для среднего квадратического отклонения.

**Тема 5. Проверка статистических гипотез**

Проверка статистических гипотез. Нулевая и альтернативная гипотезы. Проверка гипотезы с помощью статистического критерия.

Ошибки первого и второго рода и этапы проверки статистической гипотезы.

**Тема 6. Многомерные случайные величины**

Многомерные случайные величины. Совместная функция и плотность распределения случайных величин.

Корреляция случайных величин и характеризующие ее параметры. Корреляционный момент и коэффициент корреляции.

**Тема 7. Основные понятия корреляционно-регрессионного анализа**

Основные положения теории корреляции. Виды корреляционной взаимосвязи переменных. Уравнение регрессии.

Виды регрессионной зависимости результативного признака и примеры использования уравнений регрессии в экономике.

**Тема 8. Основные понятия, предмет и область применения эконометрики**

Предмет и метод эконометрики. Эконометрический подход к изучению экономических явлений и процессов. Понятие эконометрической модели, классификация моделей. Основные этапы построения эконометрической модели. Области применения эконометрических моделей.

**Тема 9. Парная регрессия и корреляция**

Понятие о функциональной, статистической и корреляционной связях. Основные задачи прикладного корреляционно-регрессионного анализа.

Уравнение регрессии, его смысл и экономическая интерпретация. Выбор типа математической функции при построении уравнения регрессии. Парная регрессия. Метод наименьших квадратов и условия его применения для определения параметров уравнения парной регрессии. Нелинейные модели регрессии и их линеаризация.

Оценка степени тесноты связи между количественными переменными. Показатели корреляции: линейный коэффициент корреляции, индекс корреляции. Коэффициент детерминации. Стандартная ошибка уравнения регрессии.

Оценка статистической значимости показателей корреляции, параметров уравнения регрессии, уравнения регрессии в целом: t-критерий Стьюдента, F-критерий Фишера.

**Тема 10. Модели множественной линейной регрессии**

Модели множественной линейной регрессии (ММЛР). Оценка параметров ММЛР. Метод наименьших квадратов и метод максимального правдоподобия. Предпосылки метода наименьших квадратов. Статистические свойства МНК-оценок параметров ММЛР (состоятельность, несмещенность, эффективность).

Стандартизированные коэффициенты регрессии, их интерпретация. Множественный коэффициент корреляции и множественный коэффициент детерминации. Оценка качества модели множественной регрессии.

Прогнозирование на основе регрессионных моделей.

**Тема 11. Спецификация эконометрической модели**

Методы выбора экзогенных переменных (идентификация пропущенных и избыточных переменных). Методы выбора формы зависимости эндогенной и экзогенных переменных (нелинейная регрессия).

**Тема 12. Эконометрический анализ при нарушении классических модельных предположений**

Гетероскедастичность и ее экономическая интерпретация. Обобщенный МНК (ОМНК), свойства оценок ОМНК. Критерии проверки гетероскедастичности: Парка, Голдфилда-Квандта, Бриша-Пагана, Уайта. Автокорреляция ошибок модели. Критерий Дарбина-Вотсона. Мультиколлинеарность экзогенных переменных. Критерии обнаружения мультиколлинеарности. Оценивание модели по главным компонентам.

**Тема 13. Модели с фиктивными (дихотомическими) переменными**

Проверка однородности выборочных данных (критерий Чоу). Модель ANOVA. Использование фиктивных переменных в анализе сезонности.

**Тема 14. Моделирование временных рядов**

Виды динамических моделей и примеры их использования в эконометрическом анализе.

Понятие стационарного временного ряда. Оценка параметров уравнения тренда. Автокорреляция остатков, ее интерпретация. Методы обнаружения и измерение автокорреляции.

Анализ временных рядов при наличии периодических колебаний: аддитивная и мультипликативная модели. Методы определения трендовой, сезонной и случайной составляющих временного ряда.

**Тема 15. Динамические эконометрические модели**

Лаговые модели. Виды структуры оператора запаздывания во времени экзогенных переменных (Койка, Алмон, Бокса-Дженкинса). Примеры лаговых моделей в экономике: модель адаптивных информационных ожиданий и др.). Критерии диагностики автокорреляции в лаговых моделях Параметрические модели выделения тренда. Стационарные модели: авторегрессии и скользящего среднего. Оценка структуры и параметров стационарных моделей. Прогнозирование временных рядов.

**Тема 16. Система одновременных эконометрических уравнений (СЭУ)**

Составляющие систем уравнений. Структурная и приведенная формы СЭУ. Проблема идентифицируемости. Критерии проверки идентифицируемости СЭУ. Методы оценивания параметров СЭУ. Косвенный метод наименьших квадратов. Двухшаговый метод наименьших квадратов. Свойства оценок.

**ИНФОРМАЦИОННО-МЕТОДИЧЕСКАЯ ЧАСТЬ**

**Нормативные правовые акты:**

1. Об информации, информатизации и защите информации [Электронный ресурс] : Закон Респ. Беларусь, 10 нояб. 2008 г., № 455-З : в ред. от 11.05.2016 // ЭТАЛОН. Законодательство Республики Беларусь / Нац. центр правовой информ. Респ. Беларусь. – Минск, 2023.

2. О некоторых мерах по реализации Закона Республики Беларусь «Об информации, информатизации и защите информации» и о признании утратившими силу некоторых постановлений Совета Министров Республики Беларусь [Электронный ресурс] : постановление Совета Министров Респ. Беларусь, 26 мая 2009 г. № 673 : в ред. от 09.04.2014 // ЭТАЛОН. Законодательство Республики Беларусь / Нац. центр правовой информ. Респ. Беларусь. – Минск, 2023.

3. О концепции информационной безопасности Республики Беларусь. Утверждена постановлением Совета безопасности Республики Беларусь № 1 от 18.03.2019 г. Подписано Президентом Республики Беларусь А.Г. Лукашенко
18 марта 2019 г. // СБ Беларусь сегодня. Спец. выпуск. – 21 марта.

4. О некоторых вопросах совершенствования использования национального сегмента глобальной компьютерной сети Интернет [Электронный ресурс] : постановление Совета Министров Респ. Беларусь, 29 апр. 2010 г. № 644 : с изм. и доп. от 31.12 2014 г. № 1281 // ЭТАЛОН. Законодательство Республики Беларусь / Нац. реестр правовых актов Респ. Беларусь. – Минск, 2023.

5. Государственная программа «Цифровое развитие Беларуси» на 2021 – 2025 годы: Министерство связи и информатизации Республики Беларусь − Режим доступа: https://www.mpt.gov.by/ru/gosudarstvennaya-programma-cifrovoe-razvitie-belarusi-na-2021-2025-gody. – Дата доступа : 27.12.2023.

6. Закон Республики Беларусь. Об электронном документе и электронной цифровой подписи от 28.12.2009 г. № 113-З (изм. от 8 ноября 2018 г.
№ 143-З) [Электронный ресурс] : Национальный реестр правовых актов Республики Беларусь, 2010 г., №15, 2/1665 − Режим доступа: https://pravo.by/document/?guid=3961&p0=H10900113. – Дата доступа : 27.12.2023.

**Основная литература:**

1. Анализ временных рядов и прогнозирование : учебник / В. Н. Афанасьев. – Ай Пи Ар Медиа – Саратов, Оренбургский гос. ун-т. – Оренбург: 2020.–- 286 с.
2. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры / И. И. Елисеева [и др.]; под ред. И. И. Елисеевой. — М.: Издательство Юрайт, 2019. – 449 с.
3. Громов, Е. И., Скрипниченко Ю. С., Молчаненко С. А., Барсуков М. Г., Капустина Е. И. Эконометрика (базовый уровень). Econometrics (basic level): Учебное пособие. — СПб.: Издательство «Лань», 2022. — 144 с.
4. Воскобойников Ю. Е. Эконометрика в Excel. Модели временных рядов: учебное пособие / Ю. Е. Воскобойников.— 2-е изд., стер. – СПб. : Лань, 2020. – 152 с.
5. Кремер, Н. Ш.  Эконометрика : учебник и практикум для академического бакалавриата / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко ; под редакцией Н. Ш. Кремера. – 4-е изд., испр. и доп. – М. : Юрайт, 2019. — 308 с.
6. Евсеев, Е. А.Эконометрика : учеб. пособие для бакалавриата и специалитета / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. – 2-е изд., испр. и доп. – М. : Юрайт, 2019. – 186 с.

**Дополнительная литература:**

1. Рон Хайндман и Джордж Атанасопулос Прогнозирование: принципы и практика / пер. с англ. А. В. Логунова. – М.: ДМК Пресс, 2023. – 458 с.
2. Крохин, А. Л. Теория вероятностей и математическая статистика с элементами дополненной реальности : учебное пособие / А. Л. Крохин; Министерство науки и высшего образования Российской Федерации, Уральский федеральный университет. — Екатеринбург : Урал. ун-т, 2022. — 190 с.
3. Ганичева, А. В. Эконометрика : учебник для СПО / А. В. Ганичева,

А. В. Ганичев. — Санкт\_Петербург : Лань, 2021.— 116 с.

1. Артемчик, В. В. Основы идеологии белорусского государства : методические рекомендации к практическим занятиям для студентов всех специальностей дневной и заочной форм обучения / В.В.Артемчик; Межгосударственное образовательное учреждение высшего образования «Белорусско-Российский университет». – Могилев : Белорусско-Российский университет, 2019. – 44 с.

**Рекомендуемые формы и методы обучения**

Формы обучения – лекции, лабораторные занятия, практические занятия, семинарские занятия, самостоятельная работа с использованием представленных преподавателями материалов (электронный конспект лекций, электронный практикум)

Основными методами обучения, отвечающими целям учебной дисциплины, являются:

элементы проблемного и вариативного изложения, реализуемые на лекционных занятиях;

элементы учебно-исследовательской деятельности, творческого подхода, реализуемые на лабораторных, практических и семинарских занятиях.

**Перечень рекомендуемых средств диагностики компетенций обучающихся**

Для контроля качества усвоения знаний по учебной дисциплине рекомендуется использовать следующий диагностический инструментарий:

типовые задания;

проведение коллоквиума;

устные опросы;

письменные опросы;

компьютерное тестирование;

зачет;

устный экзамен.

**Методические рекомендации по организации самостоятельной работы обучающихся**

Для организации самостоятельной работы обучающихся по учебной дисциплине используются современные информационные технологии: размещенные в сетевом доступе учебно-методических материалов (электронные учебные издания и презентации для теоретического изучения дисциплины и самостоятельной работы, материалы текущего контроля, позволяющие определить соответствие учебной деятельности обучающихся требованиям образовательных стандартов высшего образования и учебно-программной документации, в т.ч. вопросы для подготовки к зачету, экзамену, задания, тесты, вопросы для самоконтроля, список рекомендуемой литературы, информационных ресурсов).

**Требования к обучающимся при прохождении промежуточной аттестации**

В ходе промежуточной аттестации при оценивании знаний обучающихся применяются критерии оценивания, рекомендуемые Министерством образования Республики Беларусь.