Федеральное государственное бюджетное образовательное

учреждение высшего образования

Московский государственный университет имени М.В. Ломоносова

Московская школа экономики

Учебная программа утверждена

решением Ученого совета МШЭ МГУ

Протокол №\_\_\_\_\_\_

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

**Наименование дисциплины:**

***«Основы экономического прогнозирования»***

**Уровень высшего образования:**

*магистратура*

**Направление подготовки / специальность:**

*38.04.01 «Экономика»*

**Направленность (профиль)/специализация ОПОП:**

*«Экономическая и финансовая стратегия»*

Форма обучения:

*Очная*

Учебная программа утверждена

решением кафедры ЭиФС МШЭ МГУ

Протокол №\_\_\_\_\_\_

Москва

Рабочая программа дисциплины разработана в соответствии с самостоятельно установленным МГУ образовательным стандартом для реализуемых основных профессиональных образовательных программ высшего образования по направлению подготовки 38.04.01 Экономика (уровень магистратуры) в редакции, Приказ Министерства образования и науки РФ утвержденной приказом от 12 ноября 2015 г. № 132

1. Место дисциплины в структуре ОПОП ВО:

*Относится к вариативной части; является дисциплиной по выбору.*

2. Входные требования для освоения дисциплины, предварительные условия (если есть):

*Освоение следующих дисциплин «Теория стратегии и методология стратегирования», «Эконометрика» (базовый курс, включающий модели временных рядов), «Теория вероятностей и математическая статистика».*

**3.** Результаты обучения по дисциплине:

|  |
| --- |
| **Планируемые результаты обучения по дисциплине** |
| Знать методы оценки и прогнозирования социально-экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом.  Уметь составлять прогнозы основных социально- экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом.  Владеть способностью составлять прогнозы основных социально- экономических показателей деятельности предприятия, отрасли, региона и экономики в целом.  Знать методику выполнения анализа тенденций развития внешней и внутренний среды объекта стратегирования с использованием эконометрических методов и моделей.  Уметь выполнять анализ тенденций развития внешней и внутренний среды объекта стратегирования с использованием эконометрических методов и моделей.  Владеть навыками анализа тенденций развития внешней и внутренний среды объекта стратегирования с использованием эконометрических методов и моделей; владеть способностью разрабатывать отраслевые, региональные и корпоративные стратегии.  Знать методы оценки, анализа, оптимизации и прогнозирования результатов финансово-банковской деятельности с использованием эконометрических моделей.  Уметь выполнять оценки, анализ, оптимизацию и прогнозирование результатов финансово-банковской деятельности с использованием эконометрических моделей.  Владеть практическими навыками использования эконометрических моделей для оценки, анализа, оптимизации и прогнозирования результатов финансово-банковской деятельности. |

4. Объем дисциплины составляет \_\_**1**\_ з.е.

5. Содержание дисциплины, структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и виды учебных занятий:

5.1. Структура дисциплины по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических часов и виды учебных занятий (в строгом соответствии с учебным планом)

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| № п/п | Наименование разделов и тем дисциплины / Наименование разделов (этапов) практики | Трудоемкость (в ак. часах) по формам занятий (для дисциплин) и видам работ (для практик) | | | | Формы контроля |
| Аудиторная работа (с разбивкой по формам и видам) | | | Самостоятельная работа |
| Лекции | Практические занятия (семинары) | Лабораторная работа / контрольная работа / коллоквиум |
| 1. | Прогнозирование и стратегирование. Основы экономического прогнозирования. Эконометрические модели. | 2 |  |  | 4 | д/з |
| 2. | Прогнозирование с использованием моделей временных рядов. Стационарные процессы. | 2 | 2 | 1 | 2 | д/з |
| 3. | Прогнозирование с использованием моделей временных рядов. Нестационарные процессы. | 2 | 2 | 1 | 4 | д/з |
| 4. | Прогнозирование с использованием макроструктурных моделей: национальный и региональный уровень. | 2 | 2 |  | 8 | д/з |
| 5. | Зачет |  | 2 |  |  |  |
|  | **Итого** | **8** | **8** | **2** | **18** |  |

5.2. Содержание разделов (тем) дисциплины

Тема1. ***Прогнозирование и стратегирование. Основы экономического прогнозирования. Эконометрические модели.***

Понятие экономического прогнозирования. Прогнозирование и стртаегирование. Цели прогнозирования, в том числе в стртаегировании. Принципы прогнозирования. Типология методов прогнозирования. Отличия прогнозов с различными временными границами. Примеры прогностических исследований. Эффективность прогнозирования. Эконометрическое моделирование – как раздел экономико-математического моделирования. Типы и особенности эконометрических моделей. Применение различных типов эконометрических моделей на разных стадиях разработки стратегии. Макроэкономическое прогнозирование. Эконометрическая модель сценарных прогнозов основных макроэкономических показателей РФ. Отличие применения эконометрического моделирования в процессах стратегирования и прогнозирования.

Тема 2. ***Прогнозирование с использованием моделей временных рядов. Стационарные процессы.***

Стационарность. Процессы скользящего среднего порядка q (MA(q)). Процессы авторегрессии порядка p (AR(p)). Процесс авторегрессии-скользящего среднего порядка p, q (ARMA(p,q)).

Контрольная работа №1.

Тема 3. ***Прогнозирование с использованием моделей временных рядов. Нестационарные процессы.***

Стационарность относительно тренда. Интегрированные процессы. Тесты на наличие единичного корня. Метод Бокса-Дженкинса. Прогнозирование по модели Бокса-Дженкинса. Применение в стратегировании.

Контрольная работа №2.

Тема 4. ***Прогнозирование с использованием структурных моделей: национальный и региональный уровень.***

Структурная макроэконометрическая модель. Таблицы «затраты-выпуск». Балансовая модель. Модель экономических взаимодействий. Обсуждение результатов, полученных по реальным моделям и модельным комплексам (российский и зарубежный опыт).

6. Фонд оценочных средств (ФОС, оценочные и методические материалы) для оценивания результатов обучения по дисциплине

6.1. Типовые контрольные задания и иные материалы для проведения текущего контроля успеваемости, критерии и шкалы оценивания (в отсутствие утвержденных соответствующих локальных нормативных актов на факультете)

Самостоятельное решение задач в течение семестра на практических занятиях. Выполнение контрольных работ.

6.2. Типовые контрольные задания и иные материалы для проведения промежуточной аттестации по дисциплине, критерии и шкалы оценивания (в отсутствие утвержденных соответствующих локальных нормативных актов на факультете)

Каждый студент выполняет индивидуальный проект: постановка и решение задачи моделирования социально-экономического явления или процесса с использованием эконометрической модели.

7. Ресурсное обеспечение:

7.1. Перечень основной и дополнительной литературы

**А. Основная литература**

*1. Айвазян С.А., Мхитарян В.С*.Прикладная статистика и основы эконометрики. Издание 2-е. Том 1: Теория вероятностей и прикладная статистика. М.: Юнити. 2001 — 656 с.

*2. Айвазян С.А., Мхитарян В.С.* Прикладная статистика и основы эконометрики. Издание 2-е. Том 2: Основы эконометрики. М.: Юнити. 2001. — 432с.

1. Квинт В. Л. Концепция стратегирования. — СЗИУ РАНХиГС Санкт-Петербург, 2020. — 164 с. Том 2

2. Квинт В. Л. Концепция стратегирования. — СЗИУ РАНХиГС Санкт-Петербург, 2019. — 132 с. Том I

3. Квинт В.Л. Стратегия есть философия успеха //Научная Россия. - 25 октября 2019 г. - https://scientificrussia.ru/articles/nauka-strategiya

4. Kvint V. Strategy for the Global Market: Theory and Practical Applications. – Routledge, 2015. P

5. Квинт В. Стратегическое управление и экономика на глобальном формирующемся рынке. — Бюджет Москва, 2012. — С. 381

6. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры / И.И. Елисеева (и др.); под редакцией И.И. Елисеевой. – Москва: Издательство Юрайт, 2018. – 2018. – 449 с.

**Б. Дополнительная литература:**

1. *Берндт Э.Р.* Практика эконометрики: классика и современность. – М.: ЮНИТИ. 2005.

2. *Власюк Л.И.* Прогнозирование экономики макрорегиона: Дальний Восток/ Л.И. Власюк; отв. ред. акад. РАН Минакир П.А.; Рос. акад. наук, Дальневост. отд-ние, Ин-т экон. исследований. – Хабаровск. – 2012. – 208 с.

3. *Квинт, В.Л.* Разработка стратегии: мониторинг и прогнозирование внутренней и внешней среды // Управленческое консультирование. – 2015. – № 7. – С. 6-11.

*4. Квинт, В.Л* Стратегическое управление и экономика на глобальном формирующемся рынке /В.Л. Квинт. М.: Бизнес Атлас, 2012. – 626 с.

*5. Магнус Я.Р., Катышев А.К., Пересецкий А.А*. Эконометрика. Начальный курс. — М.: Дело. 2005. — 504 с.

*6. Суслов В.И., Ибрагимов Н.М. Талышева Л.П., Цыплаков А.А.* Эконометрия: Учебник. – Новосибирск: Издательство СО РАН, 2005. – 744 с.

7. *Hamilton J.D*. Time Series Analysis. — Princeton University Press, 1994.

8. Журнал “Global Strategy”

9. Журнал “STRATEGY +BUSINESS”

10. Журнал «Экономика в промышленности»

* 1. Перечень лицензионного программного обеспечения, в том числе отечественного производства (подлежит обновлению при необходимости)

Пакет EViews

* 1. Перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем (подлежит обновлению при необходимости)

[www.gks.ru](http://www.gks.ru)

[www.cbr.ru](http://www.cbr.ru)

[www.minfin.ru](http://www.minfin.ru)

[www.stata-press.com](http://www.stata-press.com)

* 1. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

[www.ceberleninka.ru](http://www.ceberleninka.ru) Научная электронная библиотека «Киберленинка»

[www.elibrary.ru](http://www.elibrary.ru) Научная электронная библиотека – eLIBRARY.ru

* 1. Описание материально-технического обеспечения.

Аудитория, проектор, компьютерный класс.

1. Соответствие результатов обучения по данному элементу ОПОП результатам освоения ОПОП указано в Общей характеристике ОПОП.
2. Разработчик (разработчики) программы.

Власюк Людмила Ивановна, канд. экон. наук, доцент.