

МОСКОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ ИМЕНИ М.В. ЛОМОНОСОВА

МОСКОВСКАЯ ШКОЛА ЭКОНОМИКИ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ

«Стратегирование: Эконометрический анализ»

Направление подготовки научно-педагогических кадров высшей квалификации

38.06.01 – Экономика

Направленность (профиль)

Экономика и управление народным хозяйством

1.Наименование дисциплины - Стратегирование: Эконометрический анализ

2. Уровень высшего образования – подготовка научно-педагогических кадров в аспирантуре.

3. Направление подготовки -38.06.01 – Экономика.

Направленность программы«Экономика и управление народным хозяйством»

4. Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП:относится к вариативной части ООП, дисциплинам по выбору; Блок 1

5. Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы (компетенциями выпускников)

Формируемые компетенции (код компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю), характеризующие этапы формирования компетенций
УК-1: Способность к критическому анализу и оценке современных научных достижений, генерированию новых идей при решении исследовательских и практических задач, в том числе в междисциплинарных областях	УМЕТЬ: анализировать альтернативные варианты решения исследовательских и практических задач и оценивать потенциальные выигрыши/проигрыши реализации этих вариантов Код У1 (УК-1) ВЛАДЕТЬ: навыками анализа методологических проблем, возникающих при решении исследовательских и практических задач, в том числе в междисциплинарных областях Код В1 (УК-1)
ОПК-1: способность самостоятельно осуществлять научно-исследовательскую деятельность в соответствующей профессиональной области с использованием современных методов исследования и информационно-коммуникационных технологий	ЗНАТЬ: Знать основной круг проблем (задач), встречающихся в избранной сфере научной деятельности, и основные способы (методы, алгоритмы) их решения Шифр 31 (ОПК-1)

	<p>УМЕТЬ: анализировать, систематизировать и усваивать передовой опыт проведения научных исследований Шифр: У3 (ОПК-1)</p>
<p>ПК-1: Владение методологией теоретических и экспериментальных исследований в области научной специальности (направленности образовательной программы)</p>	<p>ВЛАДЕТЬ: современными методами, инструментами и технологией научно-исследовательской и проектной деятельности в определенных областях экономической науки Шифр: В1 (ОПК-1)</p>
	<p>ЗНАТЬ: теоретические основания, актуальные проблемы и тенденции развития соответствующей научной области и области профессиональной деятельности Код З1 (ПК-1)</p>
	<p>УМЕТЬ: применять различные методы и инструменты при проведении исследований в определенных областях экономической науки Код У1 (ПК-1)</p>
	<p>ВЛАДЕТЬ: навыками анализа и синтеза передовых достижений в области научной специализации на базе целостного системного научного мировоззрения Код В1 (ПК-1)</p>

<p>ПК-5: способность использовать результаты исследований, знание закономерностей и тенденций развития для совершенствования организационно-экономических механизмов, методов управления, разработки стратегий деятельности предприятий, организаций, комплексов отраслей</p>	<p>ЗНАТЬ: основные источники и методы поиска информации, необходимой для разработки программ совершенствования организационно-экономических механизмов, методов управления, разработки стратегий деятельности предприятий, организаций, комплексов отраслей Код 32 (ПК-5)</p>
	<p>УМЕТЬ: разрабатывать порученные разделы, следуя выбранным методологическим и методическим подходам, представлять разработанные материалы, вести конструктивное обсуждение, дорабатывать материалы с учетом результатов их обсуждения Код У1 (ПК-5)</p>
	<p>ВЛАДЕТЬ: навыками подготовки аналитических материалов, необходимых для совершенствования организационно-экономических механизмов, методов управления, разработки стратегий деятельности предприятий, организаций, комплексов отраслей Код В1 (ПК-5)</p>

6. Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических или астрономических часов, выделенных на контактную работу обучающихся с преподавателем (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу обучающихся:

Общая трудоёмкость: 72 академических часа (2 зачетных единиц), из которых контактная работа составляет 28 часов, и 44 часа на самостоятельную работу

7. **Входные требования для освоения дисциплины (модуля), предварительные условия:** знание основ экономической теории, эконометрики, теории и методологии стратегирования

8. **Образовательные технологии:** эконометрический пакет Eviews, Excel

9. **Содержание дисциплины (модуля), структурированное по темам (разделам) с указанием отведенного на них количества академических или астрономических часов и виды учебных занятий**

№ 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.	Теоретические аспекты и методология применения эконометрического анализа в стратегировании.	1	-	-	4	
2.	Общие положения эконометрического анализа в стратегировании.	1	2	-	4	

3	Применение модели векторных авторегрессий (VAR) в стратегировании.	2	8		14	
4	Применение моделей авторегрессии с распределенным лагом (ARDL) в стратегировании.	2	6		14	
5	Другие модели эконометрического анализа и их спецификации в стратегировании.	2	2	-	8	
6	Зачет	-	2	-	-	
	Итого:	8	20	-	44	

Тема1. Теоретические аспекты и методология применения эконометрического анализа в стратегировании.

Основные понятия стратегирования. Роль и место эконометрического анализа в стратегировании. Варианты применения эконометрического анализа в стратегировании.

Тема2. Общие положения эконометрического анализа в стратегировании.

Особенности сбора и подготовки статистических данных. Понятие стационарности. Базовые эконометрические тесты для оценки качества модели. Разбор примеров.

Тема 3. Применение модели векторных авторегрессий (VAR) в стратегировании.

Модель векторной авторегрессии (VAR). Особенности применения VAR в стратегировании. Преимущества и недостатки применения VAR в стратегировании. Основные этапы построения модели векторной авторегрессии в стратегировании. Тест Грэнджера (Granger causality test). Функции импульсных откликов.

Тема 4. Применение моделей авторегрессии с распределенным лагом (ARDL) в стратегировании.

Особенности применения ARDL в стратегировании. Основные допущения моделирования ARDL. Основные этапы построения ARDL в стратегировании. Основные случаи и их интерпретация. Преимущества и недостатки применения ARDL в стратегировании.

Тема 5. Другие модели эконометрического анализа и их спецификации в стратегировании.

Модель векторной корреляции ошибок (VECM). Специфика применения VECM в стратегировании. Основные этапы построения модели. Преимущества и недостатки. Модель нелинейной авторегрессии с распределенным лагом NARDL. Основные этапы построения.

10. Учебно-методические материалы для самостоятельной работы аспирантов.

-Перечень основной и дополнительной учебной литературы.

-Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».

11. Ресурсное обеспечение:

1. Перечень основной и дополнительной учебной литературы.

Основная литература

Тема 1-2.

- Kvint V.L. Strategy for the Global Market: Theory and Practical Applications. – Routledge, 2015.
- Айвазян С. А. Методы эконометрики. – 2010.
- Магнус Я. Р., Катышев П. К., Пересецкий А. А. Эконометрика. Начальный курс. – М. : Дело, 1997.
- Jarque, C.M. and Bera, A.K. (1980) Efficient Tests for Normality, Homoscedasticity and Serial Independence of Regression Residuals. *Economics Letters*, 6, 255-259.
- Dickey, D.A. and Fuller, W.A. (1981) Likelihood Ratio Statistics for Autoregressive Time Series with a Unit Root. *Econometrica*, 49, 1057-1072.

Тема 3.

- Айвазян С. А. Методы эконометрики. – 2010.
- Эконометрика: учебник / под ред. И.И. Елисеевой. –М.: Финансы и статистика, 2002. – 344 с.
- Sims C.A. Macroeconomics and reality // *Econometrica: Journal of the Econometric Society*. – 1980. – С. 1–48.
- Банников В.А. Векторные модели авторегрессии и коррекции регрессионных остатков (Eviews) // *Прикладная эконометрика*. 2006. № 3. С. 96–129.
- Суханова Е. И., Ширнаева С. Ю. Прогнозирование показателей стабилизационных процессов экономики России на основе моделей векторной авторегрессии // *Фундаментальные исследования*. – 2014. – Т. 7. – №. 9.

Тема 4.

- Nkoro E. et al. Autoregressive Distributed Lag (ARDL) cointegration technique: application and interpretation // *Journal of Statistical and Econometric Methods*. – 2016. – Т. 5. – №. 4. – С. 63-91.
- Hassler U., Wolters J. Autoregressive distributed lag models and cointegration // *Modern Econometric Analysis*. – Springer, Berlin, Heidelberg, 2006. – С. 57-72.
- Hill R. C. et al. Undergraduate econometrics. – New York : Wiley, 2001. – Т. 4.

Тема 5.

- Shin Y., Yu B., Greenwood-Nimmo M. Modelling asymmetric cointegration and dynamic multipliers in a nonlinear ARDL framework //Festschrift in Honor of Peter Schmidt. – Springer, New York, NY, 2014. – С. 281-314.
- Eberhardt M. M., Presbitero A. This time they are different: heterogeneity and nonlinearity in the relationship between debt and growth. – International Monetary Fund, 2013. – №. 13-248.
- Hendry, D. F., Pagan, A. R., &Sargan, J. D. (1984). Chapter 18 Dynamic specification. Handbook of Econometrics, 1023–1100.

Дополнительная литература

2. Перечень основных ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

<http://www.gks.ru> (Росстат)

<http://epp.eurostat.ec.europa.eu/portal/page/portal/statistics/themes> (Евростат)

<http://www.imf.org/external/data.htm> (МВФ)

<http://data.worldbank.org> (Всемирный банк)

<http://www.oecd.org> (ОЭСР)

3. Описание материально-технической базы: мультимедийные комплексы и интерактивные доски; учебно-методический ресурсный центр научной библиотеки МГУ

12. Язык преподавания – русский

13. Форма обучения: очная и заочная

14. Составитель: к.э.н. Шаклеина М.В.

Оценочные средства для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации.

ШКАЛА И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ РЕЗУЛЬТАТА ОБУЧЕНИЯ по дисциплине (модулю)				
Оценка/Результат	2	3	4	5
Знания	Отсутствие знаний в области применения эконометрического анализа в стратегировании	Фрагментарные знания в области применения эконометрического анализа в стратегировании	Общие, но не структурированные знания в области применения эконометрического анализа в стратегировании	Сформированные систематические знания в области применения эконометрического анализа в стратегировании
Умения	Отсутствие умений в области применения эконометрического анализа в стратегировании	В целом успешное, но не систематическое умение в применении эконометрического анализа в стратегировании	В целом успешное, но содержащее отдельные пробелы умение в применении эконометрического анализа в стратегировании (допускает неточности принципиального характера)	Успешное и систематическое умение в области применения эконометрического анализа в стратегировании
Навыки (владения)	Отсутствие навыков применяемых при решении задач области применения эконометрического анализа в стратегировании	Наличие отдельных навыков применяемых при решении задач области применения эконометрического анализа в стратегировании	В целом сформированные навыки, применяемые при решении задач области применения эконометрического анализа в стратегировании	Сформированные навыки, применяемые при решении задач области применения эконометрического анализа в стратегировании

Уровень освоения компетенций обучающимися оценивается на основе соответствующих карт компетенций, приведённых на сайте в разделе аспирантура

Фонд оценочных средств

1. Методы выставления оценки, критерии оценивания, требования, баллы, из чего формируется оценка:

- оценка общего качества работы студента в течение семестра – 50%;
- самостоятельные работы – 50%.

2. Критерии и процедуры оценивания результатов обучения по дисциплине (модулю), характеризующих этапы формирования компетенций.

Планируемые результаты обучения	«Дескриптор»	Критерии и показатели оценивания результатов обучения	Оценочные средства	
		Незачет	Зачет	
ЗНАТЬ:	Знает современные научные достижения, в том числе в области стратегирования (УК-1)	Не знает	Знает	Активная работа на практических занятиях, самостоятельная работа
	Знает основной круг проблем, которые встречаются в избранной сфере научной деятельности (ОПК-1)	Не знает	Знает	
	Знает содержание теории, эконометрических моделей и методов, которые могут быть применимы в стратегировании (ПК-1)	Не знает	Знает	
	Знает основные подходы, роль и место эконометрического анализа в процессе стратегирования (ПК-5)	Не знает	Знает	

УМЕТЬ:	Умеет проводить критический анализ и оценку современных научных достижений, в том числе в области стратегирования (УК-1)	Не умеет	Умеет
	Умеет систематизировать основные достижения и ключевые тенденции в науке (ОПК-1)	Не умеет	Умеет
	Умеет применять эконометрические модели и методы в стратегировании (ПК-1)	Не умеет	Умеет
	Умеет применять эконометрический анализ в стратегировании, систематизировать и обосновать полученные результаты в процессе разработки стратегий (ПК-5)	Не умеет	Умеет
ВЛАДЕТЬ:	Владеет навыками критического анализа современных научных достижений, в том числе в области стратегирования (УК-1)	Не владеет	Владеет
	Владеет современными методами и инструментами научно-исследовательской деятельности (ОПК-1)	Не владеет	Владеет
	Владеет навыками эконометрического анализа в процессе стратегирования (ПК-1)	Не владеет	Владеет
	Владеет навыками эконометрического анализа, систематизации и обоснования результатов в процессе разработки стратегий (ПК-5)	Не владеет	Владеет