

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
ВЛАДИВОСТОКСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
КАФЕДРА МАТЕМАТИКИ И МОДЕЛИРОВАНИЯ

Рабочая программа дисциплины (модуля)
ЭКОНОМЕТРИКА

Направление и направленность (профиль)
01.03.04 Прикладная математика. Цифровая экономика

Год набора на ОПОП
2023

Форма обучения
очная

Владивосток 2025

Рабочая программа дисциплины (модуля) «Эконометрика» составлена в соответствии с требованиями ФГОС ВО по направлению подготовки 01.03.04 Прикладная математика (утв. приказом Минобрнауки России от 10.01.2018г. №11) и Порядком организации и осуществления образовательной деятельности по образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры (утв. приказом Минобрнауки России от 06.04.2021 г. N245).

Составитель(и):

Кучерова С.В., кандидат физико-математических наук, доцент, Кафедра математики и моделирования, Svetlana.Kucherova@vvsu.ru

Утверждена на заседании кафедры математики и моделирования от 15.05.2025 ,
протокол № 9

СОГЛАСОВАНО:

Заведующий кафедрой (разработчика)

Галимзянова К.Н.

ДОКУМЕНТ ПОДПИСАН ЭЛЕКТРОННОЙ ПОДПИСЬЮ	
Сертификат	1599657997
Номер транзакции	0000000000EA0117
Владелец	Галимзянова К.Н.

1 Цель, планируемые результаты обучения по дисциплине (модулю)

Целью освоения дисциплины «Эконометрика» является изучение методов количественного выражения взаимосвязей экономических процессов и явлений, а также методов анализа информации и прогнозирования развития бизнес-процессов.

Задачами освоения дисциплины являются: поиск, сбор, анализ и систематизация статистических данных в экономике и управлении; применение статистического инструментария при принятии управленческих решений; умение использовать в профессиональной деятельности основные многомерные статистические методы обработки и анализа данных; освоение основных методов бизнес-прогнозирования.

Планируемыми результатами обучения по дисциплине (модулю), являются знания, умения, навыки. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы, представлен в таблице 1.

Таблица 1 – Компетенции, формируемые в результате изучения дисциплины (модуля)

Название ОПОП ВО, сокращенное	Код и формулировка компетенции	Код и формулировка индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине		
			Код результата	Формулировка результата	
01.03.04 «Прикладная математика» (Б-ПМ)	ОПК-2 : Способен обоснованно выбирать, дорабатывать и применять для решения исследовательских и проектных задач математические методы и модели, осуществлять проверку адекватности моделей, анализировать результаты, оценивать надежность и качество функционирования систем	ОПК-2.1к : Осуществляет поиск, анализ, выбор и доработку математических методов и моделей для решения исследовательских и проектных задач	РД1	Знание	знает методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов
		ОПК-2.2к : Применяет математические методы и модели для решения исследовательских и проектных задач, осуществляет верификацию и валидацию моделей	РД2	Умение	строит стандартные теоретические и эконометрические модели; использовать соответствующий математический аппарат и инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования
	ОПК-3 : Способен понимать принципы работы современных информационных технологий и использовать их для решения задач профессиональной деятельности	ОПК-3.1к : Применяет методы математического моделирования и информационных технологий для анализа экономических процессов и систем, и повышения обоснованности управленческих решений на всех	РД3	Навык	владеет навыками современной методики построения эконометрических моделей, современных методов обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования

		уровнях экономики			
--	--	----------------------	--	--	--

В процессе освоения дисциплины решаются задачи воспитания гармонично развитой, патриотичной и социально ответственной личности на основе традиционных российских духовно-нравственных и культурно-исторических ценностей, представленные в таблице 1.2.

Таблица 1.2 – Целевые ориентиры воспитания

Воспитательные задачи	Формирование ценностей	Целевые ориентиры
Формирование гражданской позиции и патриотизма		
Развитие патриотизма и гражданской ответственности	Взаимопомощь и взаимоуважение	Активная жизненная позиция
Формирование духовно-нравственных ценностей		
Воспитание чувства долга и ответственности перед семьей и обществом	Взаимопомощь и взаимоуважение	Дисциплинированность
Формирование научного мировоззрения и культуры мышления		
Развитие творческих способностей и умения решать нестандартные задачи	Созидательный труд	Гибкость мышления
Формирование коммуникативных навыков и культуры общения		
Развитие умения эффективно общаться и сотрудничать	Взаимопомощь и взаимоуважение	Внимательность к деталям

2 Место дисциплины (модуля) в структуре ОПОП

Дисциплина «Эконометрика» относится к обязательной части «Блок 1 Дисциплины (модули)» учебных планов направлений подготовки 01.03.04 Прикладная математика

3. Объем дисциплины (модуля)

Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу с обучающимися (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу, приведен в таблице 2.

Таблица 2 – Общая трудоемкость дисциплины

Название ОПОП ВО	Форма обуче- ния	Часть УП	Семестр (ОФО) или курс (ЗФО, ОЗФО)	Трудо- емкость	Объем контактной работы (час)						СРС	Форма аттес- тации
				(З.Е.)	Всего	Аудиторная			Внеауди- торная			
						лек.	прак.	лаб.	ПА	КСР		
01.03.04 Прикладная математика	ОФО	Б1.Б	5	3	73	36	0	36	1	0	35	Э

4 Структура и содержание дисциплины (модуля)

4.1 Структура дисциплины (модуля) для ОФО

Тематический план, отражающий содержание дисциплины (перечень разделов и тем), структурированное по видам учебных занятий с указанием их объемов в соответствии с учебным планом, приведен в таблице 3.1

Таблица 3.1 – Разделы дисциплины (модуля), виды учебной деятельности и формы текущего контроля для ОФО

№	Название темы	Код ре- зультата обучения	Кол-во часов, отведенное на				Форма текущего контроля
			Лек	Практ	Лаб	СРС	
1	Определение эконометрики	РД1, РД2	2	0	2	3	групповая дискуссия по основным вопросам и проблемам изучаемой темы, контрольный тест, контрольная работа
2	Парный регрессионный анализ	РД1, РД2, РД3	6	0	6	6	групповая дискуссия по основным вопросам и проблемам изучаемой темы, защита лабораторной работы в виде презентации, контрольный тест
3	Множественный регрессионный анализ	РД1, РД2, РД3	12	0	10	8	защита лабораторной работы в виде презентации, контрольный тест
4	Системы эконометрических уравнений	РД1, РД2, РД3	4	0	8	8	контрольная работа, контрольный тест
5	Моделирование одномерных временных рядов и динамические эконометрические модели	РД1, РД2, РД3	12	0	10	10	защита лабораторной работы в виде презентации, контрольный тест
Итого по таблице			36	0	36	35	

4.2 Содержание разделов и тем дисциплины (модуля) для ОФО

Тема 1 Определение эконометрики.

Содержание темы: Этапы эконометрического исследования: постановка проблемы, получение данных, анализ их качества, спецификация модели, оценка параметров, интерпретация результатов. Задачи, решаемые при эконометрическом исследовании. Структуры данных (классификация) тип измерения; источник информации. Обобщающие количественные показатели набора данных: выборочное среднее, взвешенное среднее, медиана, мода, перцентили, квартили. Возможности нахождения количественных показателей в различных шкалах. Количественные характеристики изменчивости данных: дисперсия, среднее квадратическое отклонение, коэффициент вариации. Графическое описание данных.

Формы и методы проведения занятий по теме, применяемые образовательные технологии: лекция, лабораторные занятия.

Виды самостоятельной подготовки студентов по теме: подготовка к дискуссии, изучение материала в ЭОС (Moodle), работа с литературой, подготовка к контрольной работе, подготовка к экзаменационному тесту.

Тема 2 Парный регрессионный анализ.

Содержание темы: Спецификация модели. Оценка параметров модели методом наименьших квадратов (МНК): система нормальных уравнений. Интерпретация коэффициентов уравнения регрессии. Оценка адекватности модели: наличие связи между переменными, анализ дисперсии, коэффициент детерминации, F- критерий Фишера значимости уравнения в целом, средняя ошибка аппроксимации. Свойства оценок коэффициентов регрессии: несмещенность, точность, эффективность, состоятельность. Теорема Гаусса-Маркова. Оценки стандартных отклонений оценок параметров регрессии. Доверительные интервалы коэффициентов регрессии. оценка значимости коэффициентов модели по критерию Стьюдента. Метод максимального правдоподобия нахождения оценок параметров регрессии. Типы нелинейности в регрессионной зависимости: нелинейность по экзогенным переменным, нелинейность по параметрам. Экономические взаимосвязи, для которых целесообразно применение кривых Энгеля: соотношение между спросом на определенный товар и общей суммой дохода, соотношение между спросом на определенный товар и ценой товара. Коэффициент эластичности. Статистическая обработка данных на языке программирования Python.

Формы и методы проведения занятий по теме, применяемые образовательные технологии: лекция, лабораторные занятия, метод кооперативного обучения.

Виды самостоятельной подготовки студентов по теме: подготовка к дискуссии, изучение материала в ЭОС (Moodle), работа с литературой, подготовка к лабораторной работе, подготовка к экзаменационному тесту.

Тема 3 Множественный регрессионный анализ.

Содержание темы: Спецификация модели. Отбор факторов, требования к включаемым факторам. Анализ корреляционной матрицы. Пути преодоления сильной межфакторной корреляции. Выбор формы уравнения регрессии. Метод наименьших квадратов для уравнений в обычном и стандартизованном масштабах. Ранжирование факторов с помощью «стандартизованных» коэффициентов. Оценка адекватности модели. Частные уравнения регрессии. Частные коэффициенты эластичности. Проверка свойств оценок коэффициентов регрессии. Мультиколлинеарность экзогенных факторов. Статистика, используемая для проверки факторов на мультиколлинеарность, теорема об асимптотическом χ^2 -распределении данной статистики. Методы смягчения мультиколлинеарности. Оценка значимости совместного предельного вклада группы переменных с помощью F-теста. Зависимость между F- и t- статистиками. Скорректированный коэффициент детерминации. Гетероскедастичность: определение, причины и последствия гетероскедастичности. Методы обнаружения гетероскедастичности: тест ранговой корреляции Спирмена, тест Голдфелда-Квандта, тест Глейзера. Методы использования в моделях качественных переменных: метод фиктивных переменных для экзогенных факторов, logit- и probit-модели для бинарных эндогенных переменных. Множественные совокупности фиктивных переменных, интерпретация коэффициентов при фиктивных переменных. Фиктивные переменные для коэффициента наклона. Множественный регрессионный анализ на языке программирования Python.

Формы и методы проведения занятий по теме, применяемые образовательные технологии: лекция, лабораторные занятия, метод кооперативного обучения.

Виды самостоятельной подготовки студентов по теме: изучение материала в ЭОС (Moodle), работа с литературой, подготовка к лабораторной работе, подготовка к экзаменационному тесту.

Тема 4 Системы эконометрических уравнений.

Содержание темы: Классификация систем эконометрических уравнений: внешне не связанные уравнения, система рекурсивных уравнений, система одновременных уравнений. Структурная и приведённая формы модели. Идентифицируемые, неидентифицируемые, сверхидентифицируемые модели. Методы оценивания параметров

структурной модели модели: косвенный МНК, двухшаговый МНК, метод максимального правдоподобия. применения систем эконометрических уравнений: статическая модель Кейнса, динамическая модель Кейнса, динамическая модель макроэкономики Клейна, модель Хохенбалкена и Тинтнера экономики стран ЕЭС.

Формы и методы проведения занятий по теме, применяемые образовательные технологии: лекция, лабораторные занятия.

Виды самостоятельной подготовки студентов по теме: изучение материала в ЭОС (Moodle), подготовка к контрольной работе, подготовка к экзаменационному тесту.

Тема 5 Моделирование одномерных временных рядов и динамические эконометрические модели.

Содержание темы: Аддитивная и мультипликативная модели временного ряда. Циклическая, трендовая и случайная компоненты ряда. Задачи эконометрического исследования временных рядов. Автокорреляционная функция ряда и выявление структуры ряда. Аналитическое выравнивание методом скользящей средней. Моделирование сезонных и циклических колебаний, десезонализация данных. Моделирование тенденции временного ряда. Явные модели Бокса-Дженкинса (ARIMA модели). Компоненты авторегрессии и скользящего среднего. Итеративная стратегия разработки модели: проверка стационарности ряда, выбор исходной модели, оценка параметров, анализ остатков. Статистическая обработка данных на языке программирования Python.

Формы и методы проведения занятий по теме, применяемые образовательные технологии: лекция, лабораторные занятия, метод кооперативного обучения.

Виды самостоятельной подготовки студентов по теме: изучение материала в ЭОС (Moodle), работа с литературой, подготовка к лабораторной работе, подготовка к экзаменационному тесту.

5 Методические указания для обучающихся по изучению и реализации дисциплины (модуля)

5.1 Методические рекомендации обучающимся по изучению дисциплины и по обеспечению самостоятельной работы

Для лучшего освоения материала и систематизации знаний по дисциплине необходимо постоянно разбирать материалы лекций размещенных в ЭОС, отвечать на вопросы для самоконтроля в ЭОС Moodle. Во время самостоятельной проработки лекционного материала особое внимание следует уделять возникшим вопросам, непонятным терминам, спорным точкам зрения. В случае необходимости обращаться к преподавателю за консультацией. Студент должен четко уяснить, что именно с лекции начинается его подготовка к практическому занятию. Вместе с тем, лекция лишь организует мыслительную деятельность, но не обеспечивает глубину усвоения программного материала.

При подготовке к лабораторному занятию особое внимание необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов. В процессе этой работы студент должен стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, примеры, поясняющие его, а также разобраться в иллюстративном материале. В процессе подготовки рекомендуется взаимное обсуждение материала, во время которого закрепляются знания, а также приобретается практика в изложении и разъяснении полученных знаний, развивается речь.

Самостоятельная работа также включает работу на лабораторных занятиях, во время применения «Метода кооперативного обучения»: студенты работают в малых группах (4 –

5 чел.) над заданиями, в процессе выполнения которых они могут совещаться друг с другом, а также обращаться за помощью к преподавателю.

Задания для лабораторных работ с методическими указаниями по их выполнению приведены в Приложении 2.

При необходимости следует обращаться за консультацией к преподавателю. Перед консультацией, необходимо хорошо продумать вопросы, которые требуют разъяснения.

При реализации дисциплины (модуля) применяется электронный учебный курс, размещённый в системе электронного обучения Moodle.

При реализации дисциплины (модуля) применяется электронный учебный курс, размещённый в системе электронного обучения Moodle.

5.2 Особенности организации обучения для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

При необходимости обучающимся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов (по заявлению обучающегося) предоставляется учебная информация в доступных формах с учетом их индивидуальных психофизических особенностей:

- для лиц с нарушениями зрения: в печатной форме увеличенным шрифтом; в форме электронного документа; индивидуальные консультации с привлечением тифлосурдопереводчика; индивидуальные задания, консультации и др.

- для лиц с нарушениями слуха: в печатной форме; в форме электронного документа; индивидуальные консультации с привлечением сурдопереводчика; индивидуальные задания, консультации и др.

- для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата: в печатной форме; в форме электронного документа; индивидуальные задания, консультации и др.

6 Фонд оценочных средств для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации обучающихся по дисциплине (модулю)

В соответствии с требованиями ФГОС ВО для аттестации обучающихся на соответствие их персональных достижений планируемым результатам обучения по дисциплине (модулю) созданы фонды оценочных средств. Типовые контрольные задания, методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений и навыков, а также критерии и показатели, необходимые для оценки знаний, умений, навыков и характеризующие этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы, представлены в Приложении 1.

7 Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины (модуля)

7.1 Основная литература

1. Мардас, А. Н. Эконометрика : учебник и практикум для вузов / А. Н. Мардас. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2025. — 180 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-9916-8164-3. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/561438> (дата обращения: 01.09.2025).

2. Невежин, В. П. Практическая эконометрика в кейсах : учебное пособие / В. П. Невежин, Ю. В. Невежин. — Москва : ФОРУМ : ИНФРА-М, 2024. — 317 с. + Доп. материалы [Электронный ресурс]. — (Высшее образование). — DOI 10.12737/20052. - ISBN

978-5-8199-0958-4. - Текст : электронный. - URL: <https://znanium.ru/catalog/product/2134796> (Дата обращения - 05.09.2025)

3. 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> (дата обращения: 01.09.2025).

7.2 Дополнительная литература

1. Костюнин В. И. ЭКОНОМЕТРИКА. Учебник и практикум для вузов [Электронный ресурс] , 2020 - 285 - Режим доступа: <https://urait.ru/book/ekonometrika-450113>

2. Под ред. Елисеевой И.И. СТАТИСТИКА 3-е изд., пер. и доп. Учебник для вузов [Электронный ресурс] , 2020 - 361 - Режим доступа: <https://urait.ru/book/statistika-449726>

7.3 Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети "Интернет", включая профессиональные базы данных и информационно-справочные системы (при необходимости):

1. Интернет-ресурс "ТЕХНОЛОГИИ АНАЛИЗА ДАННЫХ" <http://www.basegroup.ru>

2. Научная электронная библиотека «eLIBRARY.RU» – Режим доступа: <https://elibrary.ru/>

3. Образовательная платформа "ЮРАЙТ"

4. Официальный сайт RStudio - Режим доступа: <https://rstudio.com/>

5. Система электронного обучения ВГУЭС (<http://edu.vvsu.ru>)

6. СПС КонсультантПлюс - Режим доступа: <http://www.consultant.ru/>

7. Электронно-библиотечная система "ZNANIUM.COM"

8. Электронно-библиотечная система издательства "Юрайт" - Режим доступа: <https://urait.ru/>

9. Open Academic Journals Index (ОАИ). Профессиональная база данных - Режим доступа: <http://oaji.net/>

10. Президентская библиотека им. Б.Н.Ельцина (база данных различных профессиональных областей) - Режим доступа: <https://www.prilib.ru/>

8 Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля) и перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю), включая перечень программного обеспечения

Основное оборудование:

- Компьютеры
- Проектор
- Система аудиовизуального представления информации

Программное обеспечение:

- Microsoft Office 2010 Standart
- Python

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
ВЛАДИВОСТОКСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
КАФЕДРА МАТЕМАТИКИ И МОДЕЛИРОВАНИЯ

Фонд оценочных средств
для проведения текущего контроля
и промежуточной аттестации по дисциплине (модулю)

ЭКОНОМЕТРИКА

Направление и направленность (профиль)
01.03.04 Прикладная математика. Цифровая экономика

Год набора на ОПОП
2023

Форма обучения
очная

Владивосток 2025

1 Перечень формируемых компетенций

Название ОПОП ВО, сокращенное	Код и формулировка компетенции и	Код и формулировка индикатора достижения компетенции
01.03.04 «Прикладная математика» (Б-ПМ)	ОПК-2 : Способен обоснованно выбирать, дорабатывать и применять для решения исследовательских и проектных задач математические методы и модели, осуществлять проверку адекватности моделей, анализировать результаты, оценивать надежность и качество функционирования систем	ОПК-2.1к : Осуществляет поиск, анализ, выбор и доработку математических методов и моделей для решения исследовательских и проектных задач
		ОПК-2.2к : Применяет математические методы и модели для решения исследовательских и проектных задач, осуществляет верификацию и валидацию моделей
	ОПК-3 : Способен понимать принципы работы современных информационных технологий и использовать их для решения задач профессиональной деятельности	ОПК-3.1к : Применяет методы математического моделирования и информационных технологий для анализа экономических процессов и систем, и повышения обоснованности управленческих решений на всех уровнях экономики

Компетенция считается сформированной на данном этапе в случае, если полученные результаты обучения по дисциплине оценены положительно (диапазон критериев оценивания результатов обучения «зачтено», «удовлетворительно», «хорошо», «отлично»). В случае отсутствия положительной оценки компетенция на данном этапе считается несформированной.

2 Показатели оценивания планируемых результатов обучения

Компетенция ОПК-2 «Способен обоснованно выбирать, дорабатывать и применять для решения исследовательских и проектных задач математические методы и модели, осуществлять проверку адекватности моделей, анализировать результаты, оценивать надежность и качество функционирования систем»

Таблица 2.1 – Критерии оценки индикаторов достижения компетенции

Код и формулировка индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине			Критерии оценивания результатов обучения
	Код	Тип	Результат	
ОПК-2.1к : Осуществляет поиск, анализ, выбор и доработку математических методов и моделей для решения исследовательских и проектных задач	РД 1	Знание	знает методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов	правильно отвечает на поставленные вопросы, правильно формулирует и анализирует проблему
ОПК-2.2к : Применяет математические методы и модели для решения исследовательских и проектных задач, осуществляет верификацию и валидацию моделей	РД 2	Умение	строит стандартные теоретические и эконометрические модели; использовать соответствующий математический аппарат и инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования	корректно выбирает инструменты для решения задач, выполняет все необходимые расчеты

Компетенция ОПК-3 «Способен понимать принципы работы современных информационных технологий и использовать их для решения задач профессиональной деятельности»

Таблица 2.2 – Критерии оценки индикаторов достижения компетенции

Код и формулировка индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине			Критерии оценивания результатов обучения
	Код	Тип	Результат	
ОПК-3.1к : Применяет методы математического моделирования и информационных технологий для анализа экономических процессов и систем, и повышения обоснованности управленческих решений на всех уровнях экономики	РД 3	Навык	владеет навыками современной методики построения эконометрических моделей, современных методов обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования	демонстрирует адекватные аналитические методы при работе с информацией, правильно использует алгоритмы выполнения действий, самостоятельно решает поставленные задачи

Таблица заполняется в соответствии с разделом 1 Рабочей программы дисциплины (модуля).

3 Перечень оценочных средств

Таблица 3 – Перечень оценочных средств по дисциплине (модулю)

Контролируемые планируемые результаты обучения		Контролируемые темы дисциплины	Наименование оценочного средства и представление его в ФОС	
			Текущий контроль	Промежуточная аттестация
Очная форма обучения				
РД1	Знание : знает методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов	1.1. Определение эконометрики	Дискуссия	Тест
			Тест	Тест
		1.2. Парный регрессионный анализ	Дискуссия	Тест
			Тест	Тест
		1.3. Множественный регрессионный анализ	Тест	Тест
		1.4. Системы эконометрических уравнений	Тест	Тест
		1.5. Моделирование одномерных временных рядов и динамические эконометрические модели	Тест	Тест
РД2	Умение : строит стандартные теоретические и эк	1.1. Определение эконометрики	Контрольная работа	Тест

	онометрические модели; использовать соответствующий математический аппарат и инструментальные средства для обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования	1.2. Парный регрессионный анализ	Лабораторная работа	Тест
			Тест	Тест
		1.3. Множественный регрессионный анализ	Лабораторная работа	Тест
			Тест	Тест
		1.4. Системы эконометрических уравнений	Контрольная работа	Тест
			Тест	Тест
		1.5. Моделирование одномерных временных рядов и динамические эконометрические модели	Лабораторная работа	Тест
			Тест	Тест
РДЗ	Навык : владеет навыками современной методики построения эконометрических моделей, современных методов обработки, анализа и систематизации информации по теме исследования	1.2. Парный регрессионный анализ	Лабораторная работа	Тест
		1.3. Множественный регрессионный анализ	Лабораторная работа	Тест
		1.4. Системы эконометрических уравнений	Контрольная работа	Тест
		1.5. Моделирование одномерных временных рядов и динамические эконометрические модели	Лабораторная работа	Тест

4 Описание процедуры оценивания

Качество сформированности компетенций на данном этапе оценивается по результатам текущих и промежуточных аттестаций при помощи количественной оценки, выраженной в баллах. Максимальная сумма баллов по дисциплине (модулю) равна 100 баллам.

Вид учебной деятельности	Оценочное средство					
	Тесты для контроля 1-5	Дискуссия №1, №2	КР №1, 2	ЛР № 1-3	Тест	Итого
Лекции		10				10
Лабораторные занятия				30		30
Самостоятельная работа			20			20
ЭОС	20					20
Промежуточная аттестация					20	20
Итого	20	10	20	30	20	100

Сумма баллов, набранных студентом по всем видам учебной деятельности в рамках дисциплины, переводится в оценку в соответствии с таблицей.

Сумма баллов по дисциплине	Оценка по промежуточной аттестации	Характеристика качества сформированности компетенции
от 91 до 100	«зачтено» / «отлично»	Студент демонстрирует сформированность дисциплинарных компетенций, обнаруживает всестороннее, систематическое и глубокое знание учебного материала, усвоил основную литературу и знаком с дополнительной литературой, рекомендованной программой, умеет свободно выполнять практические задания, пред

		усмотренные программой, свободно оперирует приобретенными знаниями, умениями, применяет их в ситуациях повышенной сложности.
от 76 до 90	«зачтено» / «хорошо»	Студент демонстрирует сформированность дисциплинарных компетенций: основные знания, умения освоены, но допускаются незначительные ошибки, неточности, затруднения при аналитических операциях, переносе знаний и умений на новые, нестандартные ситуации.
от 61 до 75	«зачтено» / «удовлетворительно»	Студент демонстрирует сформированность дисциплинарных компетенций: в ходе контрольных мероприятий допускаются значительные ошибки, проявляется отсутствие отдельных знаний, умений, навыков по некоторым дисциплинарным компетенциям, студент испытывает значительные затруднения при оперировании знаниями и умениями при их переносе на новые ситуации.
от 41 до 60	«не зачтено» / «неудовлетворительно»	У студента не сформированы дисциплинарные компетенции, проявляется недостаточность знаний, умений, навыков.
от 0 до 40	«не зачтено» / «неудовлетворительно»	Дисциплинарные компетенции не сформированы. Проявляется полное или практически полное отсутствие знаний, умений, навыков.

5 Примерные оценочные средства

5.1 Дискуссия

Темы для дискуссии №1

1. Этапы эконометрического исследования.
2. Классификация переменных в эконометрических моделях.
3. Структуры данных (классификация): пространственные данные и временные ряды.
4. Обобщающие количественные показатели набора данных:
5. Качественный анализ связей переменных.
6. Подбор данных.
7. Спецификация формы связи между переменными.
8. Ковариация как мера связи между переменными,
9. Возможности нахождения количественных показателей в различных шкалах.
10. Количественные характеристики изменчивости данных.

Темы для дискуссии №2

1. Взаимосвязи между F- и t- критериями оценивания в парном регрессионном анализе.
2. Коэффициент корреляции, его свойства. Индекс корреляции.
3. Средний коэффициент эластичности, частные коэффициенты эластичности, оценка влияния факторов с помощью эластичности.
4. Модель парной линейной регрессии, уравнение регрессии.
5. Условия Гаусса-Маркова, теорема Гаусса-Маркова.
6. Ошибки первого и второго рода в теории статистических гипотез.
7. Классический метод наименьших квадратов.
8. Суммы квадратов отклонений, их практический смысл
9. Проверка общего качества уравнения парной регрессии посредством F-теста и t-теста.
10. Важность доверительного интервала для прогнозного значения зависимой переменной в регрессионной модели.

Краткие методические указания

Для лучшей подготовки к дискуссиям, освоения материала и систематизации знаний по дисциплине необходимо разобрать материалы лекций по темам 1,2. Во время самостоятельной проработки лекционного материала особое внимание следует уделять возникшим вопросам, непонятным терминам, спорным точкам зрения.

Шкала оценки

Оценка	Баллы	Описание
5	8-10	выставляется студенту, если он четко представлял свою позицию, аргументировал точку зрения, оценивал аргументы других студентов, подтверждая знание материала, умение ис

		пользовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
4	5-7	если студент представлял свою позицию, но не четко аргументировал точку зрения, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
3	3-4	если студент недостаточно четко и аргументировано представлял свою позицию;
2	1-2	если студент не принимал активного участия в дискуссии.

5.2 Примеры заданий для выполнения контрольных работ

Контрольная работа № 1

1. Посмотреть в ЭОС файл ["Рекомендации для выполнения заданий"](#) в Теме 1.
2. На чистом листе MS Excel набрать исходные данные (как в примере) и применить функцию "Регрессия". Результат применения функции "Регрессия" должен совпадать с результатом в примере.
3. На том же листе MS Excel набрать столбцы произвольных чисел с помощью функции СЛЧИСЛ: три столбца (с названиями у, x1, x2) и 20 строк.
4. Применить к набранным данным функцию "Регрессия"

Контрольная работа № 2

Имеется модель денежного рынка

Задание:

Применив необходимое и достаточное условие идентификации, определите, идентифицировано ли каждое из уравнений модели: определите метод оценки параметров модели, запишите приведенную форму модели.

Краткие методические указания

При подготовке к контрольной работе особое внимание необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов по теме 4. В процессе этой работы студент должен стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, примеры, поясняющие его, а также разобраться в иллюстративном материале.

Шкала оценки

Оценка	Баллы	Описание
5	9–10	выставляется студенту, если он выполнил без существенных ошибок все задания и ответил на все поставленные вопросы, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
4	6–8	выставляется студенту, если выполнил без существенных ошибок больше половины заданий и ответил на большинство поставленных вопросы, четко представлял свою позицию, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
3	3–5	выставляется студенту, если выполнил без существенных ошибок меньше половины заданий, ответил на некоторые поставленные вопросы, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
2	1–2	выставляется студенту, если он допустил ошибки при ответах на большинство из поставленных в задаче вопросов.

5.3 Пример заданий на лабораторную работу

Лабораторная работа № 1

Задание выполняется в командах. Имеются статистические данные двух признаков у, х.

Задание

1. Построить поле корреляции.
2. Рассчитать параметры уравнений линейной, гиперболической, степенной, показательной парной регрессии. Записать уравнения в явном виде.
3. Оценить тесноту связи с помощью показателей корреляции и детерминации (для каждого уравнения).

4. Оценить значимость коэффициентов регрессий для всех моделей с помощью t-критерия Стьюдента и доверительных интервалов.
5. Оценить с помощью F-критерия Фишера статистическую надежность результатов регрессионного моделирования.
6. По значениям характеристики, рассчитанных в пп. 4,5 выбрать лучшее уравнение регрессии.
7. По лучшему уравнению рассчитать прогнозное значение результата, если прогнозное значение фактора увеличится на 10% от его среднего уровня. Определить доверительный интервал прогноза для уровня значимости $\alpha = 0,05$.

Лабораторная работа № 2

Задание выполняется в командах. Имеется набор статистических данных:

динамика индекса потребительских цен в Приморском крае за 3 года; индекс цен на продовольственные товары; индекс цен на непродовольственные товары; индекс цен на платные услуги; индекс цен производителей промышленных товаров; среднемесячная номинальная начисленная заработная плата одного работника; ставка рефинансирования ЦБ РФ.

Задание.

1. Построить уравнение множественной регрессии в линейной форме в стандартизованной и естественной форме.
2. Оценить статистическую значимость уравнения регрессии и его параметров.
3. Построить матрицу парных коэффициентов корреляции. Установить наличие коллинеарных факторов. Исключить из модели зависимые факторы.
4. Построить частные уравнения регрессии с оставшимися факторами, рассчитать частные F-критерии Фишера.
5. На основании выводов п.4 построить уравнение регрессии со статистически значимыми факторами.
6. Оценить статистическую значимость нового уравнения регрессии и его параметров.

Лабораторная работа № 3

Задание выполняется в командах. Студентам предлагается собрать статистические данные некоторого признака для исследования временного ряда.

Задание

1. Постройте график временного ряда.
2. Постройте автокорреляционную функцию данного ряда и охарактеризуйте структуру ряда.
3. Постройте мультипликативную модель данного ряда.
4. Постройте аддитивную модель данного ряда.
5. Оцените качество каждой модели и выберите лучшую модель.
6. По лучшей модели выполните прогноз объёма продаж на 1-е полугодие следующего года.

Краткие методические указания

При подготовке к каждому лабораторной работе особое внимание необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов по соответствующей теме. В процессе этой работы студент должен стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, примеры, поясняющие его, а также разобраться в иллюстративном материале.

Шкала оценки

Оценка	Баллы	Описание
5	9–10	выставляется студенту, если он принимал активное участие при решении поставленной задачи, все задания выполнены без существенных ошибок, на все поставленные вопросы даны ответы, тем самым подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;

4	6–8	выставляется студенту, без существенных ошибок выполнено больше половины заданий и на большинство поставленных вопросы даны ответы, четко представлял свою позицию и позицию команды, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
3	3–5	выставляется студенту, если без существенных ошибок выполнено меньше половины заданий, лишь на некоторые поставленные вопросы даны ответы, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции;
2	1–2	выставляется студенту, если допущены ошибки при ответах на большинство из поставленных в задаче вопросов.

5.4 Примеры тестовых заданий

Тесты для контроля (текущая аттестация)

Тест 1

1. Прочитайте текст и установите последовательность. Запишите соответствующую последовательность цифр слева направо:

Укажите последовательность этапов эконометрического исследования от 1 к 5.

- 1) постановка проблемы
- 2) спецификация модели
- 3) обработка результатов
- 4) получение данных, анализ их качества
- 5) оценка параметров

Ответ:

2. Прочитайте текст, выберите один вариант ответа.

Особенность эконометрики как прикладной науки заключается в _____ существующих взаимосвязей социально-экономических показателей и систем

- 1) качественном описании
- 2) количественном измерении
- 3) формулировании теорий
- 4) схематическом описании

Ответ:

3. Прочитайте текст, выберите один вариант ответа.

Наиболее наглядным видом выбора уравнения парной регрессии является

- 1) аналитический
- 2) графический
- 3) экспериментальный
- 4) табличный

Ответ:

4. Прочитайте текст, выберите один вариант ответа.

Для парной линейной регрессии необходим минимальный объем наблюдений, содержащий

- 1) не менее 5-7 объектов наблюдений
- 2) не менее 7-10 наблюдений
- 3) не менее 10 наблюдений
- 4) не более 30

Ответ:

5. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Какие типы данных используются в эконометрическом исследовании?

- 1) панельные данные
- 2) пространственные данные
- 3) качественные данные
- 4) временные ряды

Ответ:

6. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

На чем основан классический метод к оцениванию параметров регрессии?

- 1) методе наименьших квадратов
- 2) методе максимального правдоподобия
- 3) пошаговом регрессионном анализе
- 4) методе минимального правдоподобия

Ответ:

7. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Что показывает коэффициент регрессии b в линейном уравнении парной регрессии

- 1) показывает среднее изменение результата с изменением фактора на одну единицу
- 2) оценивает статистическую значимость уравнения регрессии
- 3) показывает, на сколько процентов изменится в среднем результат, если фактор изменится на 1%
- 4) показывает, на сколько процентов изменится в среднем фактор, если результат изменится на 1%

Ответ:

8. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Дайте определение коэффициент детерминации для парной регрессии

- 1) оценивает качество модели из относительных отклонений по каждому наблюдению
- 2) характеризует долю дисперсии результативного признака y , объясняемую регрессией, в общей дисперсии результативного признака
- 3) характеризует долю дисперсии y , вызванную влиянием не учтенных в модели факторов
- 4) оценивает качество коэффициентов модели

Ответ:

9. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Что представляет собой нелинейная парная регрессия.

- 1) вид связи между зависимой переменной и независимой переменной
- 2) характеристика количества независимых переменных, входящих в эконометрическую модель
- 3) показатель качества эконометрической модели
- 4) показатель статистической значимости параметров

Ответ:

Тест 2

1. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Какая переменная является объясняемой для парной регрессии вида $y=a+bx$

- 1) a
- 2) b
- 3) y
- 4) x

Ответ:

2. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

В чем состоит суть метода наименьших квадратов

- 1) в минимизации суммы остаточных величин

- 2) в минимизации дисперсии результативного признака
- 3) в минимизации суммы квадратов остаточных величин
- 4) в минимизации квадратов результативного признака

Ответ:

3. Прочитайте текст, запишите в ответ недостающее слово

Метод наименьших квадратов может применяться для оценки параметров исходной регрессионной модели в _____ форме.

Ответ:

4. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Какая(какие) функции наиболее часто используются во множественной регрессии ввиду четкой интерпретации параметров

- 1) линейная функция
- 2) степенная функция
- 3) показательная функция
- 4) экспоненциальная функция

Ответ:

5. Прочитайте текст задания, решите задачу, выполнив необходимые расчёты.

Запишите ответ в виде числа

Получено уравнение зависимости $y = 300 + 5x$ заработной платы y от среднедушевого прожиточного минимума x . Чему равен прогноз заработной платы y при прогнозном значении среднедушевого прожиточного минимума x , составляющем 110% от среднего уровня ($x_{ср} = 2000$)

Ответ:

6. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

По результатам анализа поля корреляции замечено, что на интервале изменения фактора меняется характер связи рассматриваемых признаков, прямая связь изменяется на обратную. На основе какой функции целесообразно проводить моделирование.

- 1) степенной функции
- 2) равносторонней гиперболы
- 3) параболы третьей степени
- 4) параболы второй степени

Ответ:

7. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Чему равен коэффициент эластичности для степенной функции

- 1) параметру регрессии a
- 2) параметру регрессии b
- 3) критерию Фишера
- 4) 0

Ответ:

8. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Что рассчитывают для оценки значимости параметров уравнения регрессии

- 1) F – критерий Фишера
- 2) t – критерий Стьюдента
- 3) коэффициент детерминации
- 4) коэффициент корреляции

Ответ:

9. Прочитайте текст задания, решите задачу, выполнив необходимые расчёты.

Запишите ответ в виде числа

Построена эконометрическая модель для зависимости прибыли от реализации единицы продукции (руб., y) от величины оборотных средств предприятия (тыс. руб., x): $y = 12,76 + 3,2x$. Чему равен средний размер прибыли от реализации, не зависящий от объема оборотных средств предприятия

Ответ:

Тест 3

1. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Каким требованиям должны отвечать факторы, включаемые во множественную регрессию

- 1) быть количественно измеримы
- 2) не должны находиться в точной функциональной связи
- 3) должны находиться в точной функциональной связи
- 4) быть сильно коррелированы

Ответ:

2. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

На основе чего может осуществляться эконометрическое моделирование зависимости по неоднородной совокупности данных

- 1) использования фиктивных переменных
- 2) разделения неоднородной совокупности данных на однородные
- 3) использования стандартизованных переменных
- 4) неоднородных статистических гипотез

Ответ:

3. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Множественный коэффициент корреляции $R(yx_1x_2)=0.9$. Определите, какой процент дисперсии зависимой переменной y объясняется влиянием факторов x_1 и x_2

- 1) 90%
- 2) 81%
- 3) 19%
- 4) 0,9%

Ответ:

4. Прочитайте текст задания, решите задачу, выполнив необходимые расчёты.

Запишите ответ в виде числа

По результатам 50 статистических наблюдений построено уравнение множественной регрессии $y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + b_3x_3 + \varepsilon$. Чему равно число степеней свободы остаточной суммы квадратов отклонений для этого уравнения.

Ответ:

5. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Относительно какой переменной регрессионная модель вида $y = a + b/x$ является нелинейной

- 1) переменной x
- 2) параметра a
- 3) переменной y
- 4) параметра b

Ответ:

6. Прочитайте текст задания, решите задачу, выполнив необходимые расчёты. выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

На основании 14 наблюдений получено уравнение множественной регрессии $y = 4,4 - 0,83x_1 + 0,5x_2 + 4x_3 + \varepsilon$ ($t a = 3,4$, $t b_1 = 1,7$, $t b_2 = 2,1$, $t b_3 = -2,3$) в скобках указаны значения t-статистики, соответствующие параметрам регрессии. Также известны критические значения Стьюдента для 10 степеней свободы для различных уровней значимости 10% - 1,81, 5% - 2,23, 1% - 3,17. Какие параметры для данного уравнения с вероятностью 99% являются значимыми

- 1) a, b_1, b_2
- 2) b_3
- 3) b_1, b_2, b_3
- 4) a

Ответ:

7. Прочитайте текст задания, решите задачу, выполнив необходимые расчёты.

Запишите ответ в виде числа

Для эконометрической модели линейного уравнения множественной регрессии построена матрица парных коэффициентов линейной корреляции (y – зависимая переменная; x_1, x_2, x_3 – независимые переменные):

	y	x_1	x_2	x_3
y	1			
x_1	0,57	1		
x_2	0,72	0,58	1	
x_3	0,89	0,82	0,89	1

Какое количество пар экзогенных переменных являются коллинеарными в данной модели

Ответ:

8. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Как определить мультиколлинеарность факторов с помощью матрицы межфакторной корреляции.

- 1) тем сильнее, чем ближе к нулю определитель матрицы межфакторной корреляции
- 2) тем сильнее, чем ближе к единице определитель матрицы межфакторной корреляции
- 3) не определяется матрицей межфакторной корреляции
- 4) тем сильнее, чем ближе к бесконечности определитель матрицы межфакторной корреляции

Ответ:

Тест 4

1. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Для чего применяется система эконометрических уравнений?

- 1) улучшения качества моделирования исследуемого явления или процесса по сравнению с отдельным уравнением регрессии
- 2) упрощения вида моделируемой связи
- 3) линеаризации моделируемого экономического процесса или явления
- 4) описания взаимосвязей между совокупностью зависимых и независимых переменных

Ответ:

2. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Чем вызвана необходимость использования систем эконометрических уравнений?

- 1) невозможностью адекватного описания экономических процессов только на основе одного уравнения
- 2) необходимостью учета всех существенных взаимосвязей внутри социально-экономической системы

- 3) отсутствием взаимосвязей между независимыми переменными регрессионной модели
- 4) более высоким качеством отдельного уравнения регрессии по сравнению с системой эконометрических уравнений

Ответ:

3. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Система эконометрических уравнений представлена в матричном виде: $BY + TX = E$, где B – матрица коэффициентов при зависимых переменных, Y – вектор зависимых переменных, T – матрица коэффициентов при объясняющих переменных, X – вектор объясняющих переменных, E – вектор ошибок. Если матрица B диагональная, то какой системой является рассматриваемая модель?

- 1) независимых уравнений
- 2) рекурсивных уравнений
- 3) взаимозависимых уравнений
- 4) нормальных уравнений

Ответ:

4. Прочитайте текст, запишите пропущенное слово

Для определения параметров структурную форму модели необходимо преобразовать в _____ форму модели

Ответ:

5. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Какая модель считается идентифицируемой.

- 1) Если число приведенных коэффициентов меньше числа структурных коэффициентов
- 2) Если число приведенных коэффициентов больше числа структурных коэффициентов
- 3) Если число параметров структурной модели равно числу параметров приведенной формы модели
- 4) Если число параметров структурной модели равно или больше числу параметров приведенной формы модели

Ответ:

6. Установите соответствие между понятиями и примерами.

К каждой позиции первого столбца подберите соответствующую позицию из второго столбца и запишите в таблицу выбранные буквы под соответствующими цифрами.

Дана структурная форма модели системы одновременных уравнений:

Рассматривается испытание: подбрасывается игральная кость.

1) e_1	A) ошибка модели
2) P_{t-1}	B) эндогенная переменная
3) y_t	C) лаговая переменная
4) b_4	D) структурный коэффициент

Запишите в ответ буквы, расположив их в порядке, соответствующем цифрам

1	2	3	4
---	---	---	---

Тест 5

1. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Какое понятие относится к временному ряду?

- 1) временно созданный набор данных
- 2) упорядоченные во времени значения показателя

- 3) ряд данных, полученный расчетным путем за короткое время
4) совокупность значений экономического показателя за несколько последовательных моментов (периодов) времени

Ответ:

2. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Что является компонентами временного ряда?

- 1) трендовая компонента
2) случайная компонента
3) циклическая (сезонная) компонента
4) временная компонента

Ответ:

3. Прочитайте текст, запишите пропущенное слово

В состав любого временного ряда, построенного по реальным данным, обязательно входит _____ компонента

Ответ:

4. Прочитайте текст, запишите пропущенное слово

Аддитивной моделью временного ряда называется модель, в которой временной ряд представлен как _____ компонент T , S и E

Ответ:

5. Прочитайте текст, сделайте вычисления, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

На основе поквартальных данных построена аддитивная модель временного ряда. Скорректированные значения сезонной компоненты за первые три квартала равны: 7 – I квартал, 9 – II квартал и –11 – III квартал. Значение сезонной компоненты за IV квартал равно

- 1) 5
2) –4
3) 4
4) –5

Ответ:

6. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Что характеризует коэффициент автокорреляции?

- 1) тесноту линейной связи текущего и предыдущего уровней ряда
2) тесноту нелинейной связи текущего и предыдущего уровней ряда
3) наличие или отсутствие тенденции
4) наличие или отсутствие случайной компоненты

Ответ:

7. Прочитайте текст, сделайте вычисления, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Уровень временного ряда (y_t) формируется под воздействием различных факторов – компонент: T (тенденция), S (циклические и/или сезонные колебания), E (случайные факторы). Аддитивную модель временного ряда формируют следующие значения компонент уровня временного ряда

- 1) $y_t = 7$; $T = 7,5$; $S = 0$; $E = -0,5$
2) $y_t = 7$; $T = 6,5$; $S = 0$; $E = -0,5$
3) $y_t = 7$; $T = 3,5$; $S = 2$; $E = 1$
4) $y_t = 7$; $T = 3,5$; $S = -2$; $E = -1$

Ответ:

8. Прочитайте текст, выберите все (один или несколько) правильные варианты ответа

Что является критерием отбора наилучшей формы тренда?

- 1) наибольшее значение скорректированного коэффициента корреляции
- 2) наименьшее значение скорректированного коэффициента корреляции
- 3) наибольшее значение скорректированного коэффициента детерминации
- 4) наименьшее значение скорректированного коэффициента детерминации

Ответ:

9. Прочитайте текст, сделайте вычисления, запишите ответ

При моделировании сезонных колебаний на основе поквартальных данных за несколько лет была получена модель $y = 8,33 + 0,19t - 2,09x_1 - 4,48x_2 - 3,91x_3$, где $x_i = 1$

для i -го квартала, $x_i = 0$ во всех остальных случаях. Прогноз на 18 квартал составит _____ (результат округлить до 0,01)

Ответ:

Краткие методические указания

Для лучшей подготовки к тестированию, освоения материала и систематизации знаний по дисциплине необходимо разобрать материалы лекций по соответствующей теме, ответить на вопросы для самопроверки по соответствующей теме. Во время самостоятельной проработки материала особое внимание следует уделять возникшим вопросам, непонятным терминам, спорным точкам зрения.

Шкала оценки

Оценка	Баллы	Описание
5	4	Выставляется студенту, если он выполнил без существенных ошибок все задания и ответил на все поставленные вопросы, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции.
4	3	Выставляется студенту, если выполнил без существенных ошибок больше половины заданий и ответил на большинство поставленных вопросов, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции.
3	2	Выставляется студенту, ответил на большую часть поставленных вопросов, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции.
2	1	Выставляется студенту, если он допустил ошибки при ответах на большинство поставленных вопросов

5.5 Примеры тестовых заданий

Промежуточная аттестация

1. Метод наименьших квадратов может применяться для оценки параметров исходной регрессионной модели в форме.

- 1) линейной форме.
- 2) нелинейной форме.
- 3) экспоненциальной форме.
- 4) нормальной форме.

2. Значение коэффициента детерминации, рассчитанное для линейного уравнения парной регрессии составило 0,81. Следовательно, значение линейного коэффициента парной корреляции может быть равно

- 1) -0,09, если $b < 0$,
- 2) 0,09, если $b > 0$,
- 3) 0,9, если $b > 0$ или -0,9, если $b < 0$,
- 4) 0,81.

3. На основании наблюдений за 50 семьями построено уравнение регрессии $y = 305,7 + 0,95x$, где y – потребление (тыс. руб.), x – доход (тыс. руб.). При увеличении дохода семьи на 1000 руб. потребление

- 1) увеличивается на 0,95 рубля,
- 2) уменьшаются на 0,95 тыс. рублей,
- 3) увеличиваются на 9,5 тыс. рублей,

- 4) увеличиваются на 950 рублей.
4. Стандартизированные коэффициенты регрессии...
 - 1) позволяют ранжировать факторы по силе их влияния на результат;
 - 2) оценивают статистическую значимость факторов;
 - 3) являются коэффициентами эластичности;
 - 4) являются коэффициентами корреляции.
5. Частные уравнения регрессии характеризуют
 - 1) силу влияния факторов на результат;
 - 2) совместное влияние факторов на результат;
 - 3) изолированное влияние фактора на результат;
 - г) изолированное влияние результата на фактор.
6. Если известно уравнение множественной регрессии $y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + b_3x_3 + \epsilon$, построенное по результатам 50 наблюдений, для которого общая сумма квадратов отклонений равна 153, и остаточная сумма квадратов отклонений равна 3, то значение F-статистики равно _____ (округлить до тысячных)
7. По уравнению регрессии
 - 1) можно сделать вывод, о том, что фактор x_3 сильнее влияет на результат, чем x_1 и x_2
 - 2) нельзя сделать вывод о силе влияния факторов на результат
 - 3) можно сделать вывод, о том, что фактор x_2 слабее влияет на результат, чем x_1 и x_3
 - 4) можно сделать вывод, о том, что фактор x_1 слабее влияет на результат, чем x_2 и x_3
8. Функция издержек производства y (тыс. руб.) характеризуется стандартизированным уравнением регрессии $t_y = 0,8 t_{x1} + 0,5 t_{x2}$, где x_1 – основные производственные фонды (тыс. руб.), x_2 – численность занятых в производстве (чел.). Частные коэффициенты корреляции первого порядка равны $r_{yx1x2} = 0,7498$ и $r_{yx2x1} = 0,5329$. Тогда можно сказать, что
 - 1) частные коэффициенты корреляции подтверждают ранжировку факторов по силе их влияния на результат
 - 2) фактор x_1 оказывает более сильное влияние на y по сравнению с x_2
 - 3) по значениям частных коэффициентов корреляции нельзя ранжировать факторы по их воздействию на результат
9. Фиктивные переменные – это
 - 1) атрибутивные признаки (например, как профессия, пол, образование), которым придали цифровые метки
 - 2) экономические переменные, принимающие количественные значения в некотором интервале
 - 3) значения зависимой переменной за предшествующий период времени
 - 4) значения независимой переменной за предшествующий период времени
10. Идентификация – это
 - 1) не единственность соответствия между приведенной и структурной формами модели
 - 2) единственность соответствия между лаговыми и зависимыми переменными
 - 3) не единственность соответствия между лаговыми и зависимыми переменными
 - 4) единственность соответствия между приведенной и структурной формами модели
11. Остаточная сумма квадратов равна нулю
 - 1) когда правильно подобрана регрессионная модель
 - 2) когда между признаками существует точная функциональная связь
 - 3) никогда
 - 4) когда неверно подобрана регрессионная модель
12. По некоторым данным об общем количестве правонарушений на таможне одного из субъектов РФ рассчитали коэффициенты автокорреляции до 8-го порядка: 0,063; 0,66;

0,036; 0,964; 0,05; 0,676; 0,069; 0,963. Анализ коэффициентов автокорреляции уровней временного ряда позволяет сделать вывод

1) никакого вывода о наличии или отсутствии в изучаемом временном ряде сезонных колебаний сделать нельзя

2) о наличии в изучаемом временном ряде сезонных колебаний периодичностью в четыре квартала

3) об отсутствии в изучаемом временном ряде сезонных колебаний

4) о наличии в изучаемом временном ряде сезонных колебаний периодичностью в шесть кварталов

13. Изучается зависимость цены квартиры (y) от ее жилой площади (x) и типа дома. В модель включены фиктивные переменные, отражающие рассматриваемые типы домов: монолитный, панельный, кирпичный. Получено уравнение регрессии: $y = 230 + 400x + 2100z_1 + 1600z_2$,

где $z_1 = (1 - \text{дом монолитный}, 0 - \text{в остальных случаях})$, $z_2 = (1 - \text{дом кирпичный}, 0 - \text{в остальных случаях})$

Частными уравнениями регрессии для кирпичного и монолитного являются

1) $y = 230 + 400x$, для типа дома кирпичный

2) $y = 1830 + 400x$, для типа дома кирпичный

3) $y = 2330 + 400x$, для типа дома монолитный

4) $y = 3930 + 400x$, для типа дома монолитный

14. 7. 95%-й доверительный интервал коэффициента регрессии (31,16; 142,52) означает, что оцениваемый параметр

1) неопределим

2) равен 31,16

3) равен 142,52

4) значим

15. Самым коротким интервалом изменения показателя множественной корреляции для уравнения множественной линейной регрессии $y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + \epsilon$, если известны парные коэффициенты корреляции $r(yx_1) = 0,8$, $r(yx_2) = 0,7$ является интервал

1) [0,8; 1]

2) [0; 1]

3) [0,7; 0,8]

4) [-1; 1]

Краткие методические указания

При подготовке к промежуточной аттестации особое внимание необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов по всем темам. При необходимости следует обращаться за консультацией к преподавателю. Перед консультацией, необходимо хорошо продумать вопросы, которые требуют разъяснения.

Шкала оценки

Оценка	Баллы	Описание
5	19–20	Выставляется студенту, если он выполнил без существенных ошибок все задания и ответил на все поставленные вопросы, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции.
4	16–18	Выставляется студенту, если выполнил без существенных ошибок больше половины заданий и ответил на большинство поставленных вопросов, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции.
3	13–15	Выставляется студенту, ответил на большую часть поставленных вопросов, подтверждая знание материала, умение использовать нормативные документы для подтверждения правильности собственной позиции.
2	9–12	Выставляется студенту, если он допустил ошибки при ответах на все поставленные вопросы