

Министерство сельского хозяйства Российской Федерации

**Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования**

**«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ АГРАРНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ ИМПЕРАТОРА ПЕТРА I»**



УТВЕРЖДАЮ

Декан экономического факультета

А.В. Агибалов

2021 г.

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ПО ДИСЦИПЛИНЕ
Б1.О.06 «Эконометрика (продвинутый уровень)»**

Направление подготовки **38.04.01 Экономика**

Направленность (профиль) **Учетно-аналитическое обеспечение бизнеса**

Квалификация выпускника **магистр**

Факультет **экономический**

Кафедра **экономического анализа, статистики и прикладной математики**

Преподаватель, подготовивший рабочую программу:
к.э.н., доцент Горелова М.В.

Воронеж-2021

Рабочая программа разработана в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования по направлению подготовки 38.04.01 «Экономика», утвержденным приказом Министерства науки и высшего образования от 11 августа 2020 г. № 939.

Рабочая программа утверждена на заседании кафедры Экономического анализа, статистики и прикладной математики (протокол № 9 от 15.06.2021)

Заведующий кафедрой, к.э.н.

подпись

В.А. Лубков

Рабочая программа рекомендована к использованию в учебном процессе методической комиссией экономического факультета (протокол № 11 от 25.06.2021).

Председатель методической комиссии

(Е.Б. Фалькович)

Рецензент рабочей программы руководитель департамента экономического развития Воронежской области, к.э.н Кустов Данил Александрович

1. Общая характеристика дисциплины

1.1. Цель изучения дисциплины

Целью дисциплины является изучение эконометрических методов исследования количественных и качественных закономерностей в экономике на основе анализа статистических данных.

1.2. Задачи изучения дисциплины

1. Показать сущность эконометрики как науки, расположенной между экономикой, статистикой и математикой;
2. Научить обучающихся использовать данные или наблюдения для построения количественных зависимостей для экономических соотношений, для выявления связей, закономерностей и тенденций развития экономических явлений,
3. Выработать у обучающихся умение формировать экономические модели, основываясь на экономической теории или на эмпирических данных, оценивать неизвестные параметры в этих моделях, делать прогнозы и оценивать их точность, давать рекомендации по экономической политике и хозяйственной деятельности.

1.3. Предмет дисциплины

Предметом дисциплины являются модели количественных и качественных экономических взаимосвязей, исследуемые с помощью математических и статистических методов и моделей.

1.4. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина Б1.О.06 Эконометрика относится к Блоку 1 Дисциплины (модули), обязательная часть образовательной программы.

1.5. Взаимосвязь с другими дисциплинами

Дисциплина Б1.О.06 Эконометрика связана со следующими дисциплинами учебного плана:

1. Б1.О.05 Микроэкономика (ПУ)

2. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Компетенция		Индикатор достижения компетенции	
Код	Содержание	Код	Содержание
ОПК-2	Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач	31	Знает современные методы экономического анализа, математической статистики и эконометрики
		32	Знает основные виды статистической информации
		У1	Умеет работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах
		У2	Умеет использовать современные методы экономического анализа, математической статистики и эконометрики для решения прикладных задач

		У3	Умеет составлять план и осуществлять статистические исследования реальной экономической ситуации с применением изученных методов
		Н1	Имеет навыки применения статистических и математических методов и моделей для решения поставленных экономических задач
		Н2	Иметь навыки работы с модулями статистических пакетов Excel и STATISTICA, позволяющие применить эконометрические методы оценивания.

Обозначение в таблице: З – обучающийся должен знать; У – обучающийся должен уметь; Н – обучающийся должен иметь навыки и (или) опыт деятельности.

3. Объём дисциплины и виды работ

3.1. Очная форма обучения

Показатели	Семестр	Всего
	1	
Общая трудоёмкость, з.е./ч	3 / 108	3 / 108
Общая контактная работа, ч	28,75	28,75
Общая самостоятельная работа, ч	79,25	79,25
Контактная работа при проведении учебных занятий, в т.ч. (ч)	28	28
лекции	14	14
практические-всего	14	14
Самостоятельная работа при проведении учебных занятий, ч	61,5	61,5
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации обучающихся, в т.ч. (ч)	0,75	0,75
групповые консультации	0,5	0,5
экзамен	0,25	0,25
Самостоятельная работа при промежуточной аттестации, в т.ч. (ч)	17,75	17,75
подготовка к экзамену	17,75	17,75
Форма промежуточной аттестации	экзамен	экзамен

3.2. Заочная форма обучения

Показатели	Курс	Всего
	1	
Общая трудоёмкость, з.е./ч	3 / 108	3 / 108
Общая контактная работа, ч	10,75	10,75
Общая самостоятельная работа, ч	97,25	97,25
Контактная работа при проведении учебных занятий, в т.ч. (ч)	10	10
лекции	4	4
практические-всего	6	6
Самостоятельная работа при проведении учебных занятий, ч	79,5	79,5
Контактная работа при проведении промежуточной аттестации обучающихся, в т.ч. (ч)	0,75	0,75
групповые консультации	0,5	0,5
экзамен	0,25	0,25
Самостоятельная работа при промежуточной аттестации, в т.ч. (ч)	17,75	17,75
подготовка к экзамену	17,75	17,75
Форма промежуточной аттестации	экзамен	экзамен

4. Содержание дисциплины

4.1. Содержание дисциплины в разрезе разделов и подразделов

Раздел 1. Сущность и история возникновения эконометрики.

Подраздел 1.1. О предмете исследований эконометрики.

Подраздел 1.2. Этапы развития эконометрики.

Раздел 2. Корреляционный анализ.

Подраздел 2.1. Действия с матрицами. Парные и частные коэффициенты корреляции.

Подраздел 2.2. Доверительные интервалы и проверка значимости коэффициентов корреляции.

Раздел 3. Простая линейная регрессия. Метод наименьших квадратов (МНК).

Подраздел 3.1. Основные понятия регрессионного анализа. Нахождение параметров парной регрессии с помощью МНК.

Подраздел 3.2. Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии.

Подраздел 3.3. Доверительные интервалы и прогноз по уравнению парной регрессии.

Раздел 4. Множественная регрессия.

Подраздел 4.1. Постановка задачи. МНК – оценки линейной регрессионной модели.

Подраздел 4.2. Оценки математического ожидания и ковариаций МНК- коэффициентов модели.

Оценка качества модели.

Подраздел 4.3. Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии и проверка гипотезы об их значимости. Доверительный интервал для прогнозных значений зависимой переменной.

Раздел 5. Проблема мультиколлинеарности факторов.

Подраздел 5.1. Проверка мультиколлинеарности факторов. Метод главных компонент.

Подраздел 5.2. Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции.

Процедура шаговой регрессии.

Раздел 6. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные).

Подраздел 6.1. Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными.

Подраздел 6.2. Тест Г. Чоу для проверки структурных изменений модели.

Подраздел 6.3. Выбор модели оптимальной сложности. Тесты Акайка и Шварца.

Раздел 7. Гетероскедастичность моделей, ее обнаружение и методы устранения гетероскедастичности.

Подраздел 7.1 Определение гетероскедастичности модели.

Подраздел 7.2. Тестирование гетероскедастичности. Подходы к решению проблемы гетероскедастичности.

Подраздел 7.3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Теорема Айткена и обобщенный метод наименьших квадратов.

4.2. Распределение контактной и самостоятельной работы при подготовке к занятиям по подразделам

4.2.1. Очная форма обучения

Разделы, подразделы дисциплины	Контактная работа			СР
	лекции	ЛЗ	ПЗ	
Раздел 1. Сущность и история возникновения эконометрики.	2	2		6,75
Подраздел 1.1. О предмете исследований эконометрики.	1	1		4,75
Подраздел 1.2. Этапы развития эконометрики.	1	1		2
Раздел 2. Корреляционный анализ.	2	2		8,75
Подраздел 2.1. Действия с матрицами. Парные и частные коэффициенты корреляции.	1	1		4,75

Подраздел 2.2. Доверительные интервалы и проверка значимости коэффициентов корреляции.	1	1		4
Раздел 3. Простая линейная регрессия. Метод наименьших квадратов (МНК).	2	2		8,75
Подраздел 3.1. Основные понятия регрессионного анализа. Нахождение параметров парной регрессии с помощью МНК.	1	1		4,75
Подраздел 3.2. Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии.	0,5	0,5		2
Подраздел 3.3. Доверительные интервалы и прогноз по уравнению парной регрессии.	0,5	0,5		2
Раздел 4. Множественная регрессия.	2	2		8,75
Подраздел 4.1. Постановка задачи. МНК – оценки линейной регрессионной модели.	1	1		4,75
Подраздел 4.2. Оценки математического ожидания и ковариаций МНК- коэффициентов модели. Оценка качества модели.	0,5	0,5		2
Подраздел 4.3. Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии и проверка гипотезы об их значимости. Доверительный интервал для прогнозных значений зависимой переменной.	0,5	0,5		2
Раздел 5. Проблема мультиколлинеарности факторов.	2	2		11
Подраздел 5.1. Проверка мультиколлинеарности факторов. Метод главных компонент.	1	1		5
Подраздел 5.2. Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции. Процедура шаговой регрессии.	1	1		6
Раздел 6. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные).	2	2		8,75
Подраздел 6.1. Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными.	1	1		4,75
Подраздел 6.2. Тест Г. Чоу для проверки структурных изменений модели.	0,5	0,5		2
Подраздел 6.3. Выбор модели оптимальной сложности. Тесты Акайка и Шварца.	0,5	0,5		2
Раздел 7. Гетероскедастичность моделей, ее обнаружение и методы устранения гетероскедастичности.	2	2		8,75
Подраздел 7.1 Определение гетероскедастичности модели.	1	1		4,75
Подраздел 7.2. Тестирование гетероскедастичности. Подходы к решению проблемы гетероскедастичности.	0,5	0,5		2
Подраздел 7.3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Теорема Айткена и обобщенный метод наименьших квадратов.	0,5	0,5		2
Всего	14	14		61,5

4.2.2. Заочная форма обучения

Разделы, подразделы дисциплины	Контактная работа			СР
	лекции	ЛЗ	ПЗ	
Раздел 1. Сущность и история возникновения эконометрики.				
Подраздел 1.1. О предмете исследований эконометрики.				
Подраздел 1.2. Этапы развития эконометрики.				
Раздел 2. Корреляционный анализ.				
Подраздел 2.1. Действия с матрицами. Парные и частные коэффициенты корреляции.				
Подраздел 2.2. Доверительные интервалы и проверка значимости коэффициентов корреляции.				
Раздел 3. Простая линейная регрессия. Метод наименьших квадратов (МНК).	2	3		39,75
Подраздел 3.1. Основные понятия регрессионного анализа. Нахождение параметров парной регрессии с помощью МНК.	1	1		13,25
Подраздел 3.2. Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии.	0,5	1		13,25
Подраздел 3.3. Доверительные интервалы и прогноз по уравнению парной регрессии.	0,5	1		13,25
Раздел 4. Множественная регрессия	2	3		39,75
Подраздел 4.1. Постановка задачи. МНК – оценки линейной регрессионной модели.	1	1		13,25
Подраздел 4.2. Оценки математического ожидания и ковариаций МНК- коэффициентов модели. Оценка качества модели.	0,5	1		13,25
Подраздел 4.3. Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии и проверка гипотезы об их значимости. Доверительный интервал для прогнозных значений зависимой переменной.	0,5	1		13,25
Раздел 5. Проблема мультиколлинеарности факторов.				
Подраздел 5.1. Проверка мультиколлинеарности факторов. Метод главных компонент.				
Подраздел 5.2. Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции. Процедура шаговой регрессии.				
Раздел 6. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные).				
Подраздел 6.1. Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными.				
Подраздел 6.2. Тест Г. Чоу для проверки структурных изменений модели.				
Подраздел 6.3. Выбор модели оптимальной сложности. Тесты Акайка и Шварца.				
Раздел 7. Гетероскедастичность моделей, ее обнаружение и методы устранения гетероскедастичности.				
Подраздел 7.1 Определение гетероскедастичности модели.				

Подраздел 7.2. Тестирование гетероскедастичности. Подходы к решению проблемы гетероскедастичности.				
Подраздел 7.3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Теорема Айткена и обобщенный метод наименьших квадратов.				
Всего	4	6		79,5

4.3. Перечень тем и учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся

Разделы, подразделы дисциплины	Учебно-методическое обеспечение	Объем часов СР	
		очная	заочная
Раздел 1. Сущность и история возникновения эконометрики.			
О предмете исследований эконометрики.	Басовский, Л. Е. Эконометрика : учебное пособие / Л.Е. Басовский. — Москва : РИОР : ИНФРА-М, 2022. — 48 с. — (ВО: Бакалавриат). - ISBN 978-5-369-01569-8. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1816736	4,75	
Этапы развития эконометрики.		2	
Раздел 2. Корреляционный анализ			
Действия с матрицами. Парные и частные коэффициенты корреляции.	Агаларов, З. С. Эконометрика : учебник / З. С. Агаларов, А. И. Орлов. - Москва : Дашков и К, 2021. - 380 с. - ISBN 978-5-394-04075-7. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1232779	4,75	
Доверительные интервалы и проверка значимости коэффициентов корреляции.		4	
Раздел 3. Простая линейная регрессия. Метод наименьших квадратов (МНК)			
Основные понятия регрессионного анализа. Нахождение параметров парной регрессии с помощью МНК.	Пособие для проведения лабораторных работ для очной и заочной форм обучения направление подготовки: 38.03.01 "Экономика" / [А. Г. Буховец и др.] ; Воронежский государственный аграрный университет ; [под ред. А. Г. Буховца] .— Воронеж : Воронежский государственный аграрный университет, 2018 .— 192 с. : ил. — Авторы указаны на обороте титульного листа .— Библиогр.: с. 6 .— <URL: http://catalog.vsau.ru/elib/books/b1465541.pdf >.	4,75	13,25
Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии.		2	13,25
Доверительные интервалы и прогноз по уравнению парной регрессии.		2	13,25
Раздел 4. Множественная регрессия			
Постановка задачи. МНК – оценки линейной регрессионной модели.	Колемаев, В. А. Эконометрика : учебник / В.А. Колемаев. — Москва : ИНФРА-М, 2017. — 160 с. — (Высшее образование: Бакалавриат). - ISBN 978-5-16-012763-7. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/768143	4,75	13,25
Оценки математического ожидания и ковариаций МНК- коэффициентов		2	13,25

модели. Оценка качества модели.			
Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии и проверка гипотезы об их значимости. Доверительный интервал для прогнозных значений зависимой переменной.		2	13,25
Раздел 5. Проблема мультиколлинеарности факторов.			
Проверка мультиколлинеарности факторов. Метод главных компонент.	Яковлев, В. П. Эконометрика : учебник для бакалавров / В. П. Яковлев. — Москва : Издательско-торговая корпорация «Дашков и К°», 2019. - 384 с. - ISBN 978-5-394-02532-7. - Текст : электронный. URL: https://znanium.com/catalog/product/1091204	5	
Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции. Процедура шаговой регрессии.		6	
Раздел 6. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные)			
Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными.	Агаларов, З. С. Эконометрика : учебник / З. С. Агаларов, А. И. Орлов. - Москва : Дашков и К, 2021. - 380 с. - ISBN 978-5-394-04075-7. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1232779	4,75	
Тест Г. Чоу для проверки структурных изменений модели.	Агаларов, З. С. Эконометрика : учебник / З. С. Агаларов, А. И. Орлов. - Москва : Дашков и К, 2021. - 380 с. - ISBN 978-5-394-04075-7. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1232779	2	
Выбор модели оптимальной сложности. Тесты Акайка и Шварца.	Агаларов, З. С. Эконометрика : учебник / З. С. Агаларов, А. И. Орлов. - Москва : Дашков и К, 2021. - 380 с. - ISBN 978-5-394-04075-7. - Текст : электронный. - URL: https://znanium.com/catalog/product/1232779	2	
Раздел 7. Гетероскедастичность моделей, ее обнаружение и методы устранения гетероскедастичности.			
Подраздел 7.1 Определение гетероскедастичности модели.	Пособие для проведения лабораторных работ для очной и заочной форм обучения направление подготовки: 38.03.01 "Экономика" / [А. Г. Буховец и др.] ; Воронежский государственный аграрный университет ; [под ред. А. Г. Буховца] .— Воронеж : Воронежский государственный аграрный университет, 2018 .— 192 с. : ил. — Авторы указаны на обороте титульного листа .— Библиогр.: с. 6 .— <URL: http://catalog.vsau.ru/elib/books/b1465541.pdf >.	4,75	
Подраздел 7.2. Тестирование	Пособие для проведения лабораторных работ для очной и заочной форм обучения направление	2	

гетероскедастичности. Подходы к решению проблемы гетероскедастичности.	подготовки: 38.03.01 "Экономика" / [А. Г. Буховец и др.] ; Воронежский государственный аграрный университет ; [под ред. А. Г. Буховца] .— Воронеж : Воронежский государственный аграрный университет, 2018 .— 192 с. : ил. — Авторы указаны на обороте титульного листа .— Библиогр.: с. 6 .— <URL: http://catalog.vsau.ru/elib/books/b1465541.pdf >.		
Подраздел 7.3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Теорема Айткена и обобщенный метод наименьших квадратов.	Пособие для проведения лабораторных работ для очной и заочной форм обучения направление подготовки: 38.03.01 "Экономика" / [А. Г. Буховец и др.] ; Воронежский государственный аграрный университет ; [под ред. А. Г. Буховца] .— Воронеж : Воронежский государственный аграрный университет, 2018 .— 192 с. : ил. — Авторы указаны на обороте титульного листа .— Библиогр.: с. 6 .— <URL: http://catalog.vsau.ru/elib/books/b1465541.pdf >.	2	

5. Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации и текущего контроля

5.1. Этапы формирования компетенций

Подраздел дисциплины	Компетенция	Индикатор достижения компетенции
Подраздел 1.1. О предмете исследований эконометрики. Подраздел 1.1. О предмете исследований эконометрики.	ОПК-2	31
		32
Подраздел 1.2. Этапы развития эконометрики.	ОПК-2	У1
Подраздел 2.1. Действия с матрицами. Парные и частные коэффициенты корреляции.	ОПК-2	У1
		У2
Подраздел 2.3. Доверительные интервалы и проверка значимости коэффициентов корреляции.	ОПК-2	У2
		У3
Подраздел 3.1. Основные понятия регрессионного анализа. Нахождение параметров парной регрессии с помощью МНК.	ОПК-2	У3
		Н1
Подраздел 3.2. Предположения и проверка адекватности уравнения регрессии.	ОПК-2	Н2
		31
Подраздел 3.3. Доверительные интервалы и прогноз по уравнению парной регрессии	ОПК-2	32
		У1
Подраздел 4.1. Постановка задачи. МНК – оценки линейной регрессионной модели.	ОПК-2	У1
		У2

Подраздел 4.2. Оценки математического ожидания и ковариаций МНК- коэффициентов модели. Оценка качества модели.	ОПК-2	У2
		У3
Подраздел 4.3. Доверительные интервалы для коэффициентов регрессии и проверка гипотезы об их значимости. Доверительный интервал для прогнозных значений зависимой переменной.	ОПК-2	У3
		Н1
Подраздел 5.1. Проверка мультиколлинеарности факторов. Метод главных компонент.	ОПК-2	Н2
		З1
Подраздел 5.2. Выбор наилучшего набора переменных. Частный коэффициент корреляции. Процедура шаговой регрессии.	ОПК-2	З2
		У1
Подраздел 6.1. Линейные регрессионные модели с фиктивными переменными.	ОПК-2	У1
		У2
Подраздел 6.2. Тест Г. Чоу для проверки структурных изменений модели.	ОПК-2	У2
Подраздел 6.3. Выбор модели оптимальной сложности. Тесты Акайке и Шварца.	ОПК-2	У3
		У3
Подраздел 7.1 Определение гетероскедастичности модели.	ОПК-2	Н1
		Н2
Подраздел 7.2. Тестирование гетероскедастичности. Подходы к решению проблемы гетероскедастичности.	ОПК-2	З1
		З2
Подраздел 7.3. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Теорема Айткена и обобщенный метод наименьших квадратов.	ОПК-2	У1
		У1

5.2 Шкалы и критерии оценивания достижения компетенций

5.2.1. Шкалы оценивания достижения компетенций

Вид оценки	Оценки			
Академическая оценка по 4-х балльной шкале	неудовлетворительно	удовлетворительно	хорошо	отлично

Вид оценки	Оценки	
Академическая оценка по 2-х балльной шкале	не зачтено	зачтено

5.2.2. Критерии оценивания достижения компетенций

Критерии оценки на экзамене

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Отлично, высокий	Студент показал полные и глубокие знания программного материала, логично и аргументировано ответил на все вопросы экзаменационного билета, а также на дополнительные вопросы, способен самостоятельно решать сложные задачи дисциплины
Хорошо, продвинутый	Студент твердо знает программный материал, грамотно его излагает, не допускает существенных неточностей в ответе, достаточно полно ответил на вопросы экзаменационного билета и дополнительные вопросы, способен самостоятельно решать стандартные задачи дисциплины
Удовлетворительно, пороговый	Студент показал знание только основ программного материала, усвоил его поверхностно, но не допускал грубых ошибок или неточностей, требует наводящих вопросов для правильного ответа, не ответил на дополнительные вопросы, способен решать стандартные задачи дисциплины с помощью преподавателя
Неудовлетворительно, компетенция не освоена	Студент не знает основ программного материала, допускает грубые ошибки в ответе, не способен решать стандартные задачи дисциплины даже с помощью преподавателя

Критерии оценки тестов

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Отлично, высокий	Содержание правильных ответов в тесте не менее 90%
Хорошо, продвинутый	Содержание правильных ответов в тесте не менее 75%
Удовлетворительно, пороговый	Содержание правильных ответов в тесте не менее 50%
Неудовлетворительно, компетенция не освоена	Содержание правильных ответов в тесте менее 50%

Критерии оценки устного опроса

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент демонстрирует уверенное знание материала, четко выражает свою точку зрения по рассматриваемому вопросу, приводя соответствующие примеры
Зачтено, продвинутый	Студент демонстрирует уверенное знание материала, но допускает отдельные погрешности в ответе
Зачтено, пороговый	Студент демонстрирует существенные пробелы в знаниях материала, допускает ошибки в ответах
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент демонстрирует незнание материала, допускает грубые ошибки в ответах

Критерии оценки решения задач

Оценка, уровень достижения компетенций	Описание критериев
Зачтено, высокий	Студент уверенно знает методику и алгоритм решения задачи, не допускает ошибок при ее выполнении.
Зачтено, продвинутый	Студент в целом знает методику и алгоритм решения задачи, не допускает грубых ошибок при ее выполнении.
Зачтено, пороговый	Студент в целом знает методику и алгоритм решения задачи, допускает ошибок при ее выполнении, но способен исправить их при помощи преподавателя.
Не зачтено, компетенция не освоена	Студент не знает методику и алгоритм решения задачи, допускает грубые ошибки при ее выполнении, не способен исправить их при помощи преподавателя.

5.3. Материалы для оценки достижения компетенций

Оценочные материалы промежуточной аттестации

5.3.1.1. Вопросы к экзамену

№	Содержание	Компетенция	ИДК
1	Предмет эконометрики. Методология эконометрического исследования. Математическая и эконометрическая модель.	ОПК - 2	31
2	Понятие о корреляционной связи. Коэффициент корреляции, его свойства. Оценка значимости выборочного коэффициента корреляции.	ОПК - 2	31
3	Понятие о регрессионной зависимости. Теоретическая и выборочная регрессии. Экономическая интерпретация случайной составляющей.	ОПК - 2	31
4	Линейная регрессия по переменным и параметрам. Парная регрессия.	ОПК - 2	31
5	Оценка коэффициентов парной регрессии методом наименьших квадратов (МНК-оценки).	ОПК - 2	31
6	Свойства МНК-оценок параметров парной регрессии: равенство нулю суммы остатков, ортогональность остатков значениям зависимой переменной. Связь коэффициента корреляции и параметра b_1 . Центрированное уравнение регрессии.	ОПК - 2	31
7	Разложение суммы квадратов отклонений переменной от её выборочного среднего. Дисперсионный анализ уравнения регрессии. Значимость уравнения регрессии.	ОПК - 2	31
8	Оценка качества уравнения регрессии. Коэффициент детерминации и его свойства. Связь коэффициента детерминации и коэффициента корреляции.	ОПК - 2	31
9	Статистические свойства коэффициентов уравнения парной регрессии. Теорема Гаусса - Маркова.	ОПК - 2	31
10	Оценка дисперсии случайной составляющей. Стандартные ошибки коэффициентов парной регрессии.	ОПК - 2	31
11	Доверительные интервалы для коэффициентов парной регрессии. Значимость коэффициентов уравнения регрессии.	ОПК - 2	31

12	Прогнозирование по регрессионной модели и его точность. Доверительный интервал для прогнозных значений.	ОПК - 2	31
13	Зависимость между критериями оценки качества уравнения регрессии. Анализ остатков уравнения регрессии.	ОПК - 2	32
14	Множественная линейная регрессия в матричной форме. МНК и его геометрическая интерпретация в многомерном случае.	ОПК - 2	32
15	Система нормальных уравнений. Матричное выражение для оценок коэффициентов регрессии.	ОПК - 2	32
16	Статистические свойства МНК – оценок коэффициентов уравнения регрессии. Теорема Гаусса – Маркова.	ОПК - 2	32
17	Оценка качества уравнения регрессии. Коэффициент множественной детерминации. Коэффициент множественной детерминации, скорректированный на число степеней свободы.	ОПК - 2	32
18	Проверка гипотез о значении отдельных коэффициентов регрессионной модели.	ОПК - 2	У1
19	Интерпретация коэффициентов множественной регрессии. Стандартизированное уравнение регрессии.	ОПК - 2	У1
20	Частные коэффициенты корреляции.	ОПК - 2	У1
21	Проверка значимости совместного вклада группы переменных.	ОПК - 2	У1
22	Проверка значимости уравнения множественной регрессии.	ОПК - 2	У2
23	Доверительные интервалы для расчётных значений зависимой переменной.	ОПК - 2	У2
24	Мультиколлинеарность данных, признаки наличия мультиколлинеарности.	ОПК - 2	У2
25	Способы устранения мультиколлинеарности: шаговые методы отбора переменных, гребневая регрессия. Понятие о методе главных компонент.	ОПК - 2	У2
26	Использование качественных объясняющих переменных. Фиктивные (dummy) переменные в множественной линейной регрессии.	ОПК - 2	У2
27	Анализ регрессионной однородности двух выборок с помощью теста Чоу (Chow) и с помощью фиктивных переменных.	ОПК - 2	У3
28	Гетероскедастичность и её последствия. Обнаружение гетероскедастичности.	ОПК - 2	У3
29	Методы устранения гетероскедастичности.	ОПК - 2	У3
30	Отбор переменных в модели множественной регрессии с помощью шаговых процедур.	ОПК - 2	У3
31	Обобщённый метод наименьших квадратов (ОМНК). Взвешенный метод наименьших квадратов как частный случай ОМНК.	ОПК - 2	У3
32	Тест Чоу для проверки структурной однородности множественной линейной регрессии.	ОПК - 2	Н1

33	Основные компоненты временного ряда: трендовая, циклическая, случайная. Стационарные временные ряды.	ОПК - 2	Н1
34	Автокорреляция. Коррелограмма и ее применение.	ОПК - 2	Н1
35	Учет временного лага. Лаговый оператор. Регрессионные модели с лаговыми переменными.	ОПК - 2	Н1
36	Методы выделения тренда временного ряда.	ОПК - 2	Н1
37	Моделирование сезонных и циклических колебаний. Аддитивная и мультипликативная модели временного ряда.	ОПК - 2	Н2
38	Модели авторегрессии, их основные свойства. Коэффициент авторегрессии и проверка его значимости.	ОПК - 2	Н2
39	Построение прогноза. Прогнозные расчеты при автокоррелированности остатков.	ОПК - 2	Н2
40	Оценка точности и надежности прогноза. Проверка адекватности модели.	ОПК - 2	Н2

5.3.1.2. Задачи к зачёту
5.3.2. Оценочные материалы текущего контроля
Задачи к экзамену

№	Содержание			Компетенция	ИДК
1	Задание 1 Модель парной линейной регрессии. Имеются данные о размере среднемесячных доходов в разных группах семей			ОПК - 2	У1
	Номер группы	Среднедушевой денежный доход в месяц, руб., x	Доля оплаты труда структуре доходов семьи, %, y		
	1	79,8	64,2		
	2	152,1	66,1		
	3	199,3	69,0		
	4	240,8	70,6		
	5	282,4	72,4		
	6	301,8	74,3		
	7	385,3	76,0		
	8	457,8	77,1		
9	577,4	78,4			
Задания: 1 Рассчитать линейный коэффициент парной корреляции, оценить его статистическую значимость и построить для него доверительный интервал с уровнем значимости $\alpha=0,05$. Сделать выводы 2 Построить линейное уравнение парной регрессии y на x и оценить статистическую значимость параметров регрессии. Сделать рисунок. 3 Оценить качество уравнения регрессии при помощи коэффициента детерминации. Сделать выводы. Проверить качество уравнения регрессии при помощи F критерия Фишера. 4 Выполнить прогноз доли оплаты труда структуре доходов семьи y при прогнозном значении среднедушевого денежного дохода x, составляющем 111% от среднего уровня. Оценить точность прогноза, рассчитав ошибку прогноза и его доверительный интервал для уровня значимости $\alpha=0,05$. Сделать выводы.					
2	Задание 2 Модель парной нелинейной регрессии. По территориям Центрального района известны данные за 1995 г.			ОПК - 2	У1
	Район	Прожиточный минимум в среднем	Средний размер ежемесячных пен		

		на одного пенсионера в месяц, тыс. руб., x	тыс. руб., y		
	Брянская обл.	178	240		
	Владимирская обл.	202	226		
	Ивановская обл.	197	221		
	Калужская обл.	201	226		
	Костромская обл.	189	220		
	Орловская обл.	166	232		
	Рязанская обл.	199	215		
	Смоленская обл.	180	220		
	Тверская обл.	181	222		
	Тульская обл.	186	231		
	Ярославская обл.	250	229		
	Задания 1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. Рассчитайте параметры уравнений полулогарифмической ($y = a + b \ln x$) и показательной ($y = a \times x^b$) парной регрессии. Сделайте рисунки. 2. Дайте с помощью среднего коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом для каждой модели. Сделайте выводы. Оцените качество уравнений регрессии с помощью средней ошибки аппроксимации и коэффициента детерминации. Сделайте выводы. 3. По значениям рассчитанных характеристик выберите лучшее уравнение регрессии. Дайте экономический смысл коэффициентов выбранного уравнения регрессии 4. Рассчитайте прогнозное значение результата, если прогнозное значение фактора увеличится на 10% от его среднего уровня. Определите доверительный интервал прогноза для уровня значимости $\alpha=0,05$. Сделайте выводы.				
3	Задание 3 Модель парной линейной регрессии. Имеются данные о цене x некоторого блага и количеству y данного блага, приобретаемому домохозяйством ежемесячно в течение года			ОПК - 2	y2
	Месяц	x	y		
	1	10	110		
	2	20	75		
	3	15	100		
	4	25	80		
	5	30	60		
	6	35	55		
	7	40	40		
	8	35	80		
	9	25	60		
	10	40	30		
	11	45	40		
	12	40	30		
	Задания 1 Рассчитать линейный коэффициент парной корреляции, оценить его статистическую значимость и построить для него доверительный интервал с уровнем значимости $\alpha=0,05$. Сделайте выводы 2 Построить линейное уравнение парной регрессии y на x и оценить статистическую значимость параметров регрессии. Сделайте рисунок. 3 Оценить качество уравнения регрессии при помощи коэффициента детерминации. Сделайте выводы. Проверить качество уравнения регрессии при помощи F критерия Фишера. 4 Выполнить прогноз приобретаемого блага y при прогнозном значении цены блага x, составляющем 112% от среднего уровня. Оценить точность прогноза, рассчитав ошибку прогноза и его доверительный интервал для уровня значимости				

4	a=0,05. Сделайте выводы.			ОПК - 2	УЗ
	Задание 4 Модель парной нелинейной регрессии. По территориям Волго-Вятского Центрально-Черноземного и Поволжского районов известны данные за ноябрь 1997 г.				
	Район	Средняя заработная плата и вы-	Потребительские		
	Респ. Марий Эл	платы социального характера, тыс.	расчете на душу н		
	Респ. Мордовия	руб., x	тыс. руб., y		
	Чувашская респ.	554	302		
	Кировская обл.	560	360		
	Нижегородская обл.	545	310		
	Белгородская обл.	672	415		
	Воронежская обл.	796	452		
	Курская обл.	777	502		
	Липецкая обл.	632	355		
	Тамбовская обл.	688	416		
	Респ. Татарстан	830	501		
	Пензенская обл.	577	403		
Задания 1 Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. Рассчитайте параметры уравнений обратной ($y = 1/(a + bx)$) и полулогарифмической ($y = a + b \ln x$) парной регрессии. Сделайте рисунки. 2 Дайте с помощью среднего коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом для каждой модели. Сделайте выводы. Оцените качество уравнений регрессии с помощью средней ошибки аппроксимации и коэффициента детерминации. Сделайте выводы. 3 По значениям рассчитанных характеристик выберите лучшее уравнение регрессии. Дайте экономический смысл коэффициентов выбранного уравнения регрессии 4 Рассчитайте прогнозное значение результата, если прогнозное значение фактора увеличится на 10% от его среднего уровня. Определите доверительный интервал прогноза для уровня значимости $\alpha=0,05$.					
5	По группе предприятий, производящих однородную продукцию, известно, как зависит себестоимость единицы продукции y от факторов, приведенных в таблице. Определите с помощью коэффициентов эластичности силу влияния каждого фактора на результат. Проранжируйте факторы по силе влияния, сделайте вывод.			ОПК - 2	УЗ
	Признак-фактор	Уравнение парной регрессии	Среднее значение признака		
	Трудоемкость единицы продукции, чел.-час., x ₁	$Yx_1 = 9,3 + 9,83x_1$	$\bar{x}_1 = 1,38$		
	Объем производства, млн.ден.ед., x ₂	$Yx_2 = 0,62 + \frac{58,47}{x_2}$	$\bar{x}_2 = 2,64$		
	Цена за одну тонну энергоносителя, млн.ден.ед., x ₃	$Yx_3 = 11,73 \cdot x_3^{1,6281}$	$\bar{x}_3 = 1,503$		
	Доля прибыли, изымаемой государством, %, x ₄	$Yx_4 = 14,87 \cdot 1,016^{x_4}$	$\bar{x}_4 = 26,3$		
6	Задание 5 Модель парной линейной регрессии. Имеются данные за 7 лет относительно среднего дохода (млн. руб., x) и среднего потребления (млн. руб., y).				УЗ
	Годы	x	y		
	91	14,56	12		

	92	15,7	12,7		
	93	16,3	13		
	94	18,5	15,5	ОПК - 2	
	95	20,34	16,7		
	96	21,7	17,3		
	97	23,5	20		
	Задания 1 Рассчитать линейный коэффициент парной корреляции, оценить его статистическую значимость и построить для него доверительный интервал с уровнем значимости $\alpha=0,05$. Сделать выводы 2 Построить линейное уравнение парной регрессии y на x и оценить статистическую значимость параметров регрессии. Сделать рисунок. 3 Оценить качество уравнения регрессии при помощи коэффициента детерминации. Сделать выводы. Проверить качество уравнения регрессии при помощи F критерия Фишера. 4 Выполнить прогноз среднего потребления y при прогнозном значении x , составляющем 114% от среднего уровня. Оценить точность прогноза, рассчитав ошибку прогноза и его доверительный интервал для уровня значимости $\alpha=0,05$. Сделать выводы.				
7	По некоторым территориям районов края известны значения средней суточного душевого дохода в у.е. (фактор X) и процент от общего дохода, расходуемого на покупку продовольственных товаров (фактор Y), табл. 1. Требуется для характеристики зависимости Y от X рассчитать параметры линейной, степенной, показательной функции и выбрать оптимальную модель (провести оценку моделей через среднюю ошибку аппроксимации (A) и F - критерий Фишера.			ОПК - 2	Н1
	Район	Y	X		
	1	68,8	45,1		
	2	61,2	59		
	3	59,9	57,2		
	4	56,7	61,8		
	5	55	58,8		
	6	54,3	47,4		
8	Рассчитайте изменение длительности оборота оборотных средств за счет изменения величины оборотных средств, если выручка от реализации базисного года составила 102468 тыс. руб., отчетного года – 100469 тыс. руб.; среднегодовой остаток оборотных средств базисного года – 94672 тыс. руб., отчетного года – 91418 тыс. руб.			ОПК - 2	Н1
9	Задание 2 Модель парной нелинейной регрессии. По территориям Северо-Западного и Центрального районов известны данные за ноябрь 1997г.			ОПК - 2	Н1
	Район	Денежные доходы на душу населения, тыс. руб., x	Потребительские расходы на душу населения, тыс. руб., y		
	Архангельская обл.	913	596		
	Вологодская обл.	606	354		
	Ленинградская обл.	876	526		
	Новгородская обл.	593	412		
	Псковская обл.	754	525		
	Брянская обл.	528	367		
	Владимирская обл.	520	364		
	Ивановская обл.	539	336		
	Калужская обл.	540	409		
	Костромская обл.	682	452		
	Московская обл.	537	367		
	Орловская обл.	589	328		
Рязанская обл.	626	460			
Задания 1 Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. Рассчитайте параметры уравнений показательной ($y = a \times b^x$) и гиперболической ($y = a + b / x$)					

	парной регрессии. Сделайте рисунки. 2 Дайте с помощью среднего коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом для каждой модели. Сделайте выводы. Оцените качество уравнений регрессии с помощью средней ошибки аппроксимации и коэффициента детерминации. Сделайте выводы. 3 По значениям рассчитанных характеристик выберите лучшее уравнение регрессии. Дайте экономический смысл коэффициентов выбранного уравнения регрессии 4 Рассчитайте прогнозное значение результата, если прогнозное значение фактора увеличится на 10% от его среднего уровня. Определите доверительный интервал прогноза для уровня значимости $\alpha=0,05$.																																														
10	Задание 1 Модель парной линейной регрессии. Имеются данные за 10 лет взаимосвязи количества населения (тыс. чел., x) и количества практикующих врачей (y) <table><tr><td>Годы</td><td>x</td><td>y</td></tr><tr><td>1</td><td>10</td><td>12,1</td></tr><tr><td>2</td><td>10,3</td><td>12,6</td></tr><tr><td>3</td><td>10,4</td><td>13</td></tr><tr><td>4</td><td>10,55</td><td>13,8</td></tr><tr><td>5</td><td>10,6</td><td>14,9</td></tr><tr><td>6</td><td>10,7</td><td>16</td></tr><tr><td>7</td><td>10,75</td><td>18</td></tr><tr><td>8</td><td>10,9</td><td>20</td></tr><tr><td>9</td><td>10,9</td><td>21</td></tr><tr><td>10</td><td>11</td><td>22</td></tr></table> Задания 1 Рассчитать линейный коэффициент парной корреляции, оценить его статистическую значимость и построить для него доверительный интервал с уровнем значимости $\alpha=0,05$. Сделайте выводы 2 Построить линейное уравнение парной регрессии y на x и оценить статистическую значимость параметров регрессии. Сделайте рисунок. 3 Оценить качество уравнения регрессии при помощи коэффициента детерминации. Сделайте выводы. Проверить качество уравнения регрессии при помощи F критерия Фишера. 4 Выполнить прогноз количества практикующих врачей y при прогнозном значении x, составляющем 115% от среднего уровня. Оценить точность прогноза, рассчитав ошибку прогноза и его доверительный интервал для уровня значимости $\alpha=0,05$. Сделайте выводы.	Годы	x	y	1	10	12,1	2	10,3	12,6	3	10,4	13	4	10,55	13,8	5	10,6	14,9	6	10,7	16	7	10,75	18	8	10,9	20	9	10,9	21	10	11	22	ОПК - 2	H2											
Годы	x	y																																													
1	10	12,1																																													
2	10,3	12,6																																													
3	10,4	13																																													
4	10,55	13,8																																													
5	10,6	14,9																																													
6	10,7	16																																													
7	10,75	18																																													
8	10,9	20																																													
9	10,9	21																																													
10	11	22																																													
11	В табл. 1.2.3.1 представлены данные о производительности труда, фондоотдаче и уровне рентабельности пятнадцати предприятий. Используя матричную форму метода наименьших квадратов, по данным этой таблицы рассчитайте: 1) коэффициенты регрессии; 2) стандартные ошибки коэффициентов регрессии; 3) множественный индекс корреляции; 4) скорректированное значение множественного коэффициента детерминации; 5) бетта-коэффициенты; 6) парные коэффициенты корреляции; 7) множественный коэффициент корреляции через бета-коэффициенты и парные коэффициенты корреляции; 8) дисперсионное отношение Фишера; 9) частные F-критерии для каждого фактора. <table><tr><td>№ предприятия</td><td>Производительность труда, руб.</td><td>Фондоотдача, руб.</td><td>Уровень рентабельности, %</td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr><tr><td> </td><td> </td><td> </td><td> </td></tr></table>	№ предприятия	Производительность труда, руб.	Фондоотдача, руб.	Уровень рентабельности, %																																									ОПК - 2	H2
№ предприятия	Производительность труда, руб.	Фондоотдача, руб.	Уровень рентабельности, %																																												

		1	7343	1,08	20,1		
		2	3991	1,05	12,9		
		3	5760	0,99	18,0		
		4	3000	1,02	11,7		
		5	5241	0,98	17,9		
		6	4500	1,04	16,8		
		7	4300	1,03	15,6		
		8	3212	1,10	14,3		
		9	6743	1,03	18,1		
		10	5234	0,89	17,8		
		11	2500	0,78	13,0		
		12	3930	0,99	14,2		
		13	14333	1,43	24,2		
		14	6980	1,03	20,0		
		15	6740	1,05	19,3		
12	Руководство крупной компании ЗАО «Надежная связь», предоставляющая услуги мобильной и стационарной телефонной связи, а также осуществляющая продажу телефонных аппаратов, планирует в следующем квартале расширить свой бизнес, освоив за счет прибыли компании новую рыночную нишу – предоставление Интернет-услуг в собственном Интернет-салоне. Получите прогнозные оценки прибыли компании в следующем квартале для того, чтобы у руководства сложилось представление о возможном размере финансового обеспечения этого бизнес-плана. Для построения прогнозной модели множественной регрессии воспользуйтесь данными таблицы. Прогнозные оценки факторов, влияющие на прибыль компании, необходимо получить с помощью трендовых моделей.					ОПК - 2	Н2
		Квар- тал	Прибыль компани и, тыс. руб.	Общее число абоненто в компани и	Выручка за мобильны й трафик, тыс. руб.	Затраты на поддержание и обновление программног о обеспечения, руб.	
		1	10500	17075	7670	3200	
		2	12128	18014	7993	3460	
		3	12160	18642	8281	3500	
		4	13890	19253	8746	3750	
		5	13445	19809	9040	4260	
		6	12123	20394	9310	4870	
		7	13675	20891	9555	4880	
		8	13823	21398	9800	5680	
		9	14464	21891	10045	5720	
		10	15123	22386	10290	5830	
		11	14780	22876	10536	5940	
		12	14865	23312	10781	6890	
		13	15092	23897	11026	7550	
		14	25764	34144	19263	8340	
		15	40623	51890	29709	10120	
		16	46798	59644	34270	12230	
		17	45846	61645	34571	12470	
		18	48124	63734	35278	14890	
		19	49383	68521	36079	16240	
		20	50920	69123	37542	16710	
		21	51220	70165	38906	17560	
		22	52087	71233	39244	18430	

5.3.2.1. Вопросы тестов

	Содержание	Компетенция	ИДК
1.	Какое определение соответствует понятию «эконометрика»: а) это наука, предметом изучения которой является количественная сторона массовых социально-экономических явлений и процессов в конкретных условиях места и времени; б) это наука, предметом изучения которой является количественное выражение взаимосвязей экономических процессов и явлений; в) это наука, предметом изучения которой являются общие закономерности случайных явлений и методы количественной оценки влияния случайных факторов.	ОПК - 2	31
2.	Эконометрическая модель – это модель: а) гипотетического экономического объекта; б) конкретно-существующего экономического объекта, построенная на гипотетических данных; в) конкретно-существующего экономического объекта, построенная на статистических данных.	ОПК - 2	31
3.	Какова цель эконометрики? а) представить экономические данные в наглядном виде; б) разработать методы моделирования и количественного анализа реальных экономических объектов; в) определить способы сбора и группировки статистических данных; г) изучить качественные аспекты экономических явлений.	ОПК - 2	31
4.	Спецификация модели – это: а) определения цели исследования и выбор экономических переменных модели; б) проведение статистического анализа модели, оценка качества ее параметров; в) сбор необходимой статистической информации; г) построение эконометрических моделей с целью эмпирического анализа.	ОПК - 2	31
5.	Какая задача эконометрики является задачей параметризации модели: а) составление прогноза и рекомендаций для конкретных экономических явлений по результатам эконометрического моделирования; б) оценка параметров построения модели; в) проверка качества параметров модели и самой модели в целом; г) построение эконометрических моделей для эмпирического анализа.	ОПК - 2	31
6.	Верификация модели – это: а) определение вида экономической модели, выражение в математической форме взаимосвязи между ее переменными; б) определение исходных предпосылок и ограничений модели; в) проверка качества как модели в целом, так и ее параметров; г) анализ изучаемого экономического явления.	ОПК - 2	31
7.	Как называются эконометрические модели, представляющие собой зависимость результативного признака от времени?	ОПК - 2	31

	а) регрессионные модели; б) системы одновременных уравнений; в) модели временных рядов.		
8.	Набор сведений о разных объектах, взятых за один период времени называется: а) временными данными; б) пространственными данными.	ОПК - 2	31
9.	Выберите аналог понятия «независимая переменная»: а) эндогенная переменная; б) фактор; в) результат; г) экзогенная переменная.	ОПК - 2	31
10.	Что из нижеперечисленного не оказывает непосредственного влияния на величину ошибки регрессии: а) спецификация модели; б) выборочные характеристики исходных статистических данных; в) особенности измерения переменных; г) опыт исследователя.	ОПК - 2	31
11.	К ошибкам спецификации относятся: а) неоднородность данных в исходной статистической совокупности; б) неправильный выбор структуры математической функции для объясненной части уравнения регрессии; в) недоучет в уравнении регрессии какого-либо существенного фактора; г) ошибки измерения.	ОПК - 2	31
12.	Рассмотрите модель зависимости общей величины расходов на питание от располагаемого личного дохода x и цены продукта питания p : $y = a_0 + a_1x + a_2p + \varepsilon$. Определите класс модели и вид переменных модели: а) регрессионная модель с одним уравнением; эндогенная переменная – расходы на питание, экзогенная переменная – располагаемый личный доход, предопределенная переменная – цена продуктов питания; б) регрессионная модель с одним уравнением; эндогенная переменная – расходы на питание, экзогенные переменные – располагаемый личный доход и цена продуктов питания; в) модель временного ряда; эндогенная переменная – расходы на питание, лаговые переменные – располагаемый личный доход и цена продуктов питания.	ОПК - 2	31
13.	Связь называется корреляционной: а) если каждому значению факторного признака соответствует вполне определенное неслучайное значение результативного признака; б) если каждому значению факторного признака соответствует множество значений результативного признака, т.е. определенное статистическое распределение; в) если каждому значению факторного признака соответствует целое распределение значений результативного признака; г) если каждому значению факторного признака соответствует строго определенное значение результативного признака.	ОПК - 2	31

14.	По аналитическому выражению различают связи: а) обратные; б) линейные; в) нелинейные; г) парные.	ОПК - 2	31
15.	Регрессионный анализ заключается в определении: а) аналитической формы связи, в которой изменение результативного признака обусловлено влиянием одного или нескольких факторных признаков, а множество всех прочих факторов, также оказывающих влияние на результативный признак, принимается за постоянные и средние значения; б) тесноты связи между двумя признаками (при парной связи) и между результативным и множеством факторных признаков (при многофакторной связи); в) статистической меры взаимодействия двух случайных переменных; г) степени статистической связи между порядковыми переменными.	ОПК - 2	31
16.	Экзогенные переменные модели характеризуются тем, что они: а) датируются предыдущими моментами времени; б) являются независимыми и определяются вне системы; в) являются зависимыми и определяются внутри системы.	ОПК - 2	31
17.	17. Выберите аналог понятия «эндогенная переменная»: а) результат; б) фактор; в) зависимая переменная, определяемая внутри системы;	ОПК - 2	31
18.	Предопределенные переменные – это: а) все экзогенные и эндогенные переменные; б) только экзогенные переменные; в) все экзогенные и лаговые эндогенные переменные; г) лаговые экзогенные и эндогенные переменные.	ОПК - 2	31
19.	Лаговые переменные – это: а) все экзогенные и эндогенные переменные; б) только экзогенные переменные; в) переменные, значения которых относятся к будущим моментам времени; г) переменные, значения которых относятся к предыдущим моментам времени.	ОПК - 2	31
20.	К какому этапу эконометрического моделирования относится вычисление коэффициентов регрессии и их смысловая интерпретация? а) параметризация; б) спецификация; в) верификация; г) прогнозирование.	ОПК - 2	31
21.	К какому этапу эконометрического моделирования относится статистическая оценка достоверности параметров уравнения регрессии? а) параметризация; б) спецификация;	ОПК - 2	32

	в) верификация; г) прогнозирование.		
22.	Фиктивные переменные – это: а) переменные, не включенные в модель регрессии; б) переменные, которым соответствуют неколичественные характеристики; в) переменные, значения которых относятся к будущим моментам времени. г) переменные, значения которых относятся к предыдущим моментам времени.	ОПК - 2	32
23.	Если качественный фактор имеет три градации, то необходимое число фиктивных переменных: а) 4; б) 3; в) 2	ОПК - 2	32
24.	Суть метода наименьших квадратов состоит в а) минимизации суммы остаточных величин; б) минимизации дисперсии результативного признака; в) минимизации суммы квадратов остаточных величин.	ОПК - 2	32
25.	Классический подход к оцениванию параметров регрессии основан на: а) методе наименьших квадратов; б) методе максимального правдоподобия; в) взвешенном методе наименьших квадратов.	ОПК - 2	32
26.	На основании наблюдений за 50 семьями построено уравнение регрессии $y = 284,56 + 0,672x$, где y – потребление, x – доход. Соответствуют ли знаки и значения коэффициентов регрессии теоретическим представлениям? а) да; б) нет; в) ничего определенного сказать нельзя.	ОПК - 2	32
27.	Суть коэффициента детерминации состоит в следующем: а) оценивает качество модели из относительных отклонений по каждому наблюдению; б) характеризует долю дисперсии результативного признака y , объясняемую регрессией, в общей дисперсии результативного признака; в) характеризует долю дисперсии y , вызванную влиянием не учтенных в модели факторов.	ОПК - 2	32
28.	Качество модели из относительных отклонений регрессионного и фактического значений признака по каждому наблюдению оценивает: а) коэффициент детерминации; б) F-критерий Фишера; в) средняя ошибка аппроксимации A .	ОПК - 2	32
29.	Какое значение не может принимать парный коэффициент корреляции: а) -0,973; б) 0,005; в) 1,111; г) 0,721.	ОПК - 2	32

30.	При каком значении линейного коэффициента корреляции связь между признаками можно считать тесной: а) -0,975; б) 0,657; в) -0,111 г) 0,421.	ОПК - 2	32
31.	Какой критерий используют для оценки значимости коэффициента парной корреляции: а) F-критерий Фишера; б) t-критерий Стьюдента; в) критерий Пирсона; г) критерий Дарбина-Уотсона.	ОПК - 2	32
32.	Если парный коэффициент корреляции между признаками равен -1, то это означает: а) отсутствие связи; б) наличие обратной корреляционной связи; в) наличие прямой корреляционной связи; г) наличие обратной функциональной связи.	ОПК - 2	32
33.	Если парный коэффициент корреляции между признаками принимает значение 0,675, то коэффициент детерминации равен: а) 0,822; б) -0,675; в) 0,576; г) 0,456.	ОПК - 2	32
34.	В уравнении парной линейной регрессии $y = a + bx$ параметр b означает: а) усредненное влияние на результативный признак неучтенных (не выделенных для исследования) факторов; б) среднее изменение результативного признака при изменении факторного признака на 1 %; в) на какую величину в среднем изменится результативный признак y , если переменную x увеличить на одну единицу измерения; г) какая доля вариации результативного признака учтена в модели и обусловлена влиянием на нее переменной x ?	ОПК - 2	32
35.	В уравнении парной степенной регрессии $y\% = a \cdot x^b$ параметр b означает: а) усредненное влияние на результативный признак неучтенных (не выделенных для исследования) факторов; б) среднее изменение результативного признака при изменении факторного признака на 1 %; в) на какую величину в среднем изменится результативный признак y , если переменную x увеличить на одну единицу измерения; г) какая доля вариации результативного признака учтена в модели и обусловлена влиянием на нее переменной x ?	ОПК - 2	32
36.	Уравнение регрессии имеет вид $y\% = 2,02 + 0,78x$. На сколько единиц своего измерения в среднем изменится $y\%$ при увеличении x на одну единицу своего измерения: а) увеличится на 2,02; б) увеличится на 0,78;	ОПК - 2	32

	в) увеличится на 2,8; г) не изменится?		
37.	Какой критерий используют для оценки значимости уравнения регрессии: а) F-критерий Фишера; б) t-критерий Стьюдента; в) критерий Пирсона; г) критерий Дарбина-Уотсона.	ОПК - 2	32
38.	Какой критерий используют для оценки значимости коэффициентов регрессии: а) F-критерий Фишера; б) t-критерий Стьюдента; в) критерий Пирсона; г) критерий Дарбина-Уотсона.	ОПК - 2	32
39.	Какой коэффициент определяет среднее изменение результативного признака при изменении факторного признака на 1 %: а) коэффициент регрессии; б) коэффициент детерминации; в) коэффициент корреляции; г) коэффициент эластичности.	ОПК - 2	32
40.	Чему равен коэффициент эластичности, если уравнение регрессии имеет вид $y = 2,02 + 0,78x$, а средние значения признаков равны $x = 5$, $y = 6$: а) 0,94; б) 1,68; в) 0,65; г) 2,42.	ОПК - 2	32
41.	Остаточная сумма квадратов равна нулю в том случае, когда а) правильно подобрана регрессионная модель; б) между признаками существует точная функциональная связь; в) между признаками существует тесная корреляционная связь.	ОПК - 2	32
42.	Оценки параметров регрессии (свойства оценок метода наименьших квадратов) должны быть: а) несмещенными; б) гетерокедастичными; в) эффективными; г) состоятельными.	ОПК - 2	у1
43.	Какой коэффициент расчета регрессии показывает долю учтенной в модели вариации результативного признака у и обусловленной влиянием факторных переменных? а) коэффициент регрессии; б) коэффициент детерминации; в) коэффициент корреляции; г) коэффициент эластичности.	ОПК - 2	у1
44.	Укажите характеристики, используемые в качестве меры точности модели регрессии а) средняя абсолютная ошибка; б) остаточная дисперсия; в) коэффициент корреляции; г) средняя относительная ошибка аппроксимации.	ОПК - 2	у1

45.	Сопоставляя при регрессионном анализе факторную и остаточную дисперсии, получим величину статистики: а) Стьюдента; б) Дарбина; в) Пирсона; г) Фишера.	ОПК - 2	У1
46.	Уравнение регрессии признается в целом статистически значимым, если а) расчетное значение критерия Фишера больше соответствующего табличного значения; б) расчетное значение критерия Фишера меньше соответствующего табличного значения; в) расчетное значение критерия Фишера больше четырех; г) расчетное значение критерия Фишера больше нуля.	ОПК - 2	У1
47.	Построенное уравнение регрессии считается удовлетворительным, если значение средней ошибки аппроксимации не превышает а) 5 %; б) 1000000000000000 %; в) 1 %; г) 95 %.	ОПК - 2	У1
48.	Требования, при которых модель считается адекватной, состоят в следующем: 1 Уровни ϵ_i ряда остатков имеют случайный характер. 2 Математическое ожидание уровней ряда остатков равно нулю. 3 Дисперсия каждого отклонения ϵ_i одинакова для всех значений x (свойство гомоскедастичности). 4 Значения ϵ_i независимы друг от друга, т.е. отсутствует автокорреляция. 5 Случайные величины ϵ_i распределены по нормальному закону. 6 Число включаемых в регрессионную модель факторов в 6-7 раз меньше объема совокупности данных, по которым строится регрессия. Укажите пункт, необязательный для адекватной модели регрессии. а) 3; б) 4; в) 5; г) 6	ОПК - 2	У1
49.	Наличие гетероскедастичности в остатках регрессии можно проверить с помощью теста а) Пирсона; б) Гольфеля-Квандта; в) Дарбина-Уотсона; г) Спирмена.	ОПК - 2	У1
50.	Зависимость последовательности остатков регрессии друг от друга в эконометрике называют а) гомоскедастичностью остатков; б) мультиколлинеарностью остатков; в) автокорреляцией остатков;	ОПК - 2	У1

	г) гетероскедастичностью остатков.																	
51.	Оценить значимость парного линейного коэффициента корреляции можно при помощи а) критерия Фишера; б) теста ГольфелядаЕКвандта; в) критерия ДарбинаЕУотсона; г) критерия Стьюдента.	ОПК - 2	У1															
52.	Степень влияния неучтенных в модели факторов можно оценить с помощью: а) коэффициента детерминации; б) коэффициента регрессии; в) средней ошибки аппроксимации; г) построения линии регрессии.	ОПК - 2	У1															
53.	По группе предприятий, производящих однородную продукцию, известна зависимость себестоимости единицы продукции у от нескольких факторов <table><tr><th>Фактор</th><th>Уравнение регрессии</th><th>Среднее значение фактора</th></tr><tr><td>Объем производства, x_1</td><td>$\hat{y} = 0,62 + \frac{58,74}{x_1}$</td><td>2,64</td></tr><tr><td>Трудоемкость единицы продукции, x_2</td><td>$\hat{y} = 9,3 + 0,82x_2$</td><td>1,38</td></tr><tr><td>Оптовая цена за 1 т энергоносителя, x_3</td><td>$\hat{y} = 11,75 \cdot x_3^{1,6281}$</td><td>1,503</td></tr><tr><td>Доля прибыли, изымаемой государством, x_3</td><td>$\hat{y} = 15,62 \cdot 1,016^{x_3}$</td><td>24</td></tr></table> Ранжировать факторы с помощью коэффициентов эластичности. Указать фактор снижения себестоимости. а) объем производства; б) трудоемкость; в) цена на энергию; г) отчисляемая доля прибыли.	Фактор	Уравнение регрессии	Среднее значение фактора	Объем производства, x_1	$\hat{y} = 0,62 + \frac{58,74}{x_1}$	2,64	Трудоемкость единицы продукции, x_2	$\hat{y} = 9,3 + 0,82x_2$	1,38	Оптовая цена за 1 т энергоносителя, x_3	$\hat{y} = 11,75 \cdot x_3^{1,6281}$	1,503	Доля прибыли, изымаемой государством, x_3	$\hat{y} = 15,62 \cdot 1,016^{x_3}$	24	ОПК - 2	У1
Фактор	Уравнение регрессии	Среднее значение фактора																
Объем производства, x_1	$\hat{y} = 0,62 + \frac{58,74}{x_1}$	2,64																
Трудоемкость единицы продукции, x_2	$\hat{y} = 9,3 + 0,82x_2$	1,38																
Оптовая цена за 1 т энергоносителя, x_3	$\hat{y} = 11,75 \cdot x_3^{1,6281}$	1,503																
Доля прибыли, изымаемой государством, x_3	$\hat{y} = 15,62 \cdot 1,016^{x_3}$	24																
54.	Какая регрессия относится к основному виду регрессионных моделей в эконометрике? а) линейная; б) нелинейная; в) множественная; г) степенная.	ОПК - 2	У1															
55.	Укажите аргументы в пользу использования линейных моделей в эконометрике: а) простота расчетов при параметризации; б) только в линейной регрессии четкая экономическая интерпретация параметров; в) линейные модели лучше описывают данные с возможными ошибками измерений; г) обычно высокие коэффициенты детерминации.	ОПК - 2	У1															
56.	Укажите метод, которым нельзя руководствоваться при выборе математической структуры уравнения регрессии: а) выбор структуры с наиболее простой схемой расчетов при параметризации; б) графический метод, который базируется на поле корреляции; в) аналитический метод, основанный на изучении материальной природы связи исследуемых признаков.	ОПК - 2	У1															
57.	Укажите соответствие между показателем и его характеристикой:	ОПК - 2	У1															

	<table><tr><td>1. Коэффициент регрессии</td><td>1. Показатель тесноты связи факторов, включенных в модель регрессии</td></tr><tr><td>2. Коэффициент корреляции</td><td>2. Относительный показатель силы связи факторов</td></tr><tr><td>3. Коэффициент детерминации</td><td>3. Абсолютный показатель силы связи факторов</td></tr><tr><td>4. Коэффициент эластичности</td><td>4. Показатель степени достоверности построенного уравнения регрессии</td></tr></table>	1. Коэффициент регрессии	1. Показатель тесноты связи факторов, включенных в модель регрессии	2. Коэффициент корреляции	2. Относительный показатель силы связи факторов	3. Коэффициент детерминации	3. Абсолютный показатель силы связи факторов	4. Коэффициент эластичности	4. Показатель степени достоверности построенного уравнения регрессии		
1. Коэффициент регрессии	1. Показатель тесноты связи факторов, включенных в модель регрессии										
2. Коэффициент корреляции	2. Относительный показатель силы связи факторов										
3. Коэффициент детерминации	3. Абсолютный показатель силы связи факторов										
4. Коэффициент эластичности	4. Показатель степени достоверности построенного уравнения регрессии										
58.	Какой фактор не влияет на достоверность интервального прогноза по уравнению линейной парной регрессии? а) объем исходных статистических данных; б) установленный уровень значимости в статистических критериях; в) величина отклонения прогнозного значения факторной переменной от ее среднего в статистических данных значения; г) величина коэффициента регрессии.	ОПК - 2	У1								
59.	При небольшом объеме наблюдений (7-10) рекомендуется: а) использовать сложные нелинейные модели регрессии; б) использовать линейную регрессию; в) использовать парную регрессию с числом параметров больше одного.	ОПК - 2	У1								
60.	Объем исходных статистических данных $n = 11$. Какую спецификацию парной регрессии не следует выбирать при прочих равных условиях: а) линейную; б) экспоненциальную; в) показательную; г) квадратичную.	ОПК - 2	У1								
61.	Укажите уравнение обратной связи в парной регрессии: а) $\hat{y} = -5,79 + 36,84 \cdot x$; б) $\hat{y} = -5,79 + \frac{x}{36,84}$; в) $\hat{y} = \frac{1}{-5,79 + 36,84 \cdot x}$; г) $\hat{y} = -5,79 - 36,84 \cdot x$	ОПК - 2	У1								
62.	Укажите соответствие между уравнением регрессии и его характеристикой: <table><tr><td>1. $\hat{y} = 2,33 - 8,45 \cdot x$</td><td>1. Прямая линейная регрессия</td></tr><tr><td>2. $\hat{y} = -2,33 + 0,45 \cdot x$</td><td>2. Обратная линейная регрессия</td></tr><tr><td>3. $\hat{y} = \frac{1}{1 - 2x}$</td><td>3. Прямая нелинейная регрессия</td></tr><tr><td>4. $\hat{y} = 2,03 \cdot 0,1^x$</td><td>4. Обратная нелинейная регрессия</td></tr></table>	1. $\hat{y} = 2,33 - 8,45 \cdot x$	1. Прямая линейная регрессия	2. $\hat{y} = -2,33 + 0,45 \cdot x$	2. Обратная линейная регрессия	3. $\hat{y} = \frac{1}{1 - 2x}$	3. Прямая нелинейная регрессия	4. $\hat{y} = 2,03 \cdot 0,1^x$	4. Обратная нелинейная регрессия	ОПК - 2	У1
1. $\hat{y} = 2,33 - 8,45 \cdot x$	1. Прямая линейная регрессия										
2. $\hat{y} = -2,33 + 0,45 \cdot x$	2. Обратная линейная регрессия										
3. $\hat{y} = \frac{1}{1 - 2x}$	3. Прямая нелинейная регрессия										
4. $\hat{y} = 2,03 \cdot 0,1^x$	4. Обратная нелинейная регрессия										
63.	При оценке регрессионной модели по 30 наблюдениям были получены следующие промежуточные результаты: $\sum (y - \hat{y})^2 = 39000$ $\sum (y - \bar{y})^2 = 120000.$ Какой показатель корреляции можно определить по приведенным данным? а) коэффициент эластичности; б) среднюю ошибку аппроксимации; в) коэффициент регрессии; г) расчетное значение критерия Фишера.	ОПК - 2	У2								

64.	В процессе верификации результатов линейной парной регрессии при 17 наблюдениях стало известно, что коэффициент детерминации $R^2 = 0,71$. Найти расчетное значение критерия Фишера. а) 41,62; б) 32,72; в) 12,07.	ОПК - 2	У2																					
65.	В процессе верификации результатов линейной парной регрессии стало известно, что коэффициент детерминации $R^2 = 0,71$. Критическое значение критерия Фишера при уровне значимости 0,05 и 15 степенях свободы равно 4,54. Сделать вывод о значимости уравнения по критерию Фишера. а) Расчетное значение критерия больше критического, уравнение статистически значимо; б) Расчетное значение критерия больше критического, уравнение ненадежно; в) Расчетное значение критерия меньше критического, уравнение ненадежно; г) Расчетное значение критерия меньше критического, уравнение статистически значимо.	ОПК - 2	У2																					
66.	Получены следующие результаты при подборе уравнения парной регрессии к одним и тем же статистическим данным. Укажите наиболее подходящее уравнение: <table><tr><td>Регрессия</td><td>Коэффициент детерминации</td><td>Средняя ошибка аппроксимации</td></tr><tr><td>Степенная</td><td>0,6</td><td>1,23</td></tr><tr><td>Показательная</td><td>0,8</td><td>5,59</td></tr><tr><td>Полулогарифмическая</td><td>0,76</td><td>0,05</td></tr><tr><td>Обратная</td><td>0,79</td><td>5,69</td></tr><tr><td>Гипербола</td><td>0,69</td><td>6,65</td></tr><tr><td>Линейная</td><td>0,64</td><td>5,67</td></tr></table> а) полулогарифмическая; б) степенная; в) обратная; г) линейная.	Регрессия	Коэффициент детерминации	Средняя ошибка аппроксимации	Степенная	0,6	1,23	Показательная	0,8	5,59	Полулогарифмическая	0,76	0,05	Обратная	0,79	5,69	Гипербола	0,69	6,65	Линейная	0,64	5,67	ОПК - 2	У2
Регрессия	Коэффициент детерминации	Средняя ошибка аппроксимации																						
Степенная	0,6	1,23																						
Показательная	0,8	5,59																						
Полулогарифмическая	0,76	0,05																						
Обратная	0,79	5,69																						
Гипербола	0,69	6,65																						
Линейная	0,64	5,67																						
67.	При верификации модели регрессии получены такие данные Коэффициент корреляции 0,87 Коэффициент детерминации 0,76 Средняя ошибка аппроксимации 0,059 Расчетное значение статистики Фишера F 22,81 Соответствующее критическое значение критерия Фишера 3,68 Укажите верные выводы. а) построенное уравнение регрессии объясняет 87 % вариации зависимой переменной; б) средняя ошибка аппроксимации не превышает установленного предела в 15 %, что свидетельствует о хорошем качестве модели; в) расчетное значение критерия Фишера превышает соответствующее табличное (критическое) значение. Найденное уравнение регрессии статистически надежно. г) регрессия установила наличие тесной обратной связи между	ОПК - 2	У2																					

	признаками x и y .		
68.	Укажите уравнение множественной регрессии: а) $\tilde{y}_x = a + bx$; б) $\tilde{y} = a + bx + cx^2$; в) $\tilde{y} = a + b_1x_1 + b_2x_2 + \dots + b_kx_k$; г) $\tilde{y} = a \cdot x_1^{b_1} \cdot x_2^{b_2} \cdot \dots \cdot x_k^{b_k}$.	ОПК - 2	У2
69.	Факторы, включаемые во множественную регрессию, должны быть: а) количественно измеримы; б) функционально зависимы; в) независимы или слабо коррелированы; г) явно коллинеарны.	ОПК - 2	У2
70.	При дополнительном включении во множественную регрессию новой объясняющей переменной должны выполняться условия: а) коэффициент детерминации должен возрасти, остаточная дисперсия увеличиваться; б) коэффициент детерминации должен убывать, остаточная дисперсия увеличиваться; в) коэффициент детерминации должен возрасти, остаточная дисперсия уменьшаться; г) коэффициент детерминации должен убывать, остаточная дисперсия уменьшаться.	ОПК - 2	У2
71.	При построении модели множественной регрессии предварительно проводят исследование факторных переменных на коллинеарность и мультиколлинеарность. Считается, что две переменные явно коллинеарны, если соответствующий парный коэффициент корреляции удовлетворяет условию: а) $r_{x_i x_j} \geq 0,5$; б) $r_{x_i x_j} \geq 1$; в) $r_{x_i x_j} \geq 0,3$; г) $r_{x_i x_j} \geq 0,7$.	ОПК - 2	У2
72.	Говорят, что факторы, включенные в уравнение регрессии, мультиколлинеарны, если а) все коэффициенты корреляции $r_{x_i x_j} \leq 0,5$; б) все коэффициенты корреляции $r_{x_i x_i} \geq 1$; в) определитель матрицы межфакторной корреляции близок к нулю; г) определитель матрицы межфакторной корреляции близок к единице.	ОПК - 2	У2
73.	При построении модели множественной регрессии предварительно проводят исследование факторных переменных на коллинеарность и мультиколлинеарность. Определитель матрицы парных коэффициентов корреляции факторов подсчитан и оказался равен 0,5. Укажите верный вывод. а) мультиколлинеарность факторов доказана, результаты множественной регрессии ненадежны; б) необходимо проверить гипотезу о мультиколлинеарности	ОПК - 2	У2

	факторов; в) мультиколлинеарность факторов, безусловно, отсутствует, результаты множественной регрессии надежны; г) мультиколлинеарность факторов доказана, уравнение регрессии пригодно для прогнозирования.														
74.	Под частной корреляцией понимается: а) зависимость результативного признака и двух или более факторов, включенных в регрессионную модель; б) связь между двумя признаками (результативным и факторным или двумя факторными); в) зависимость между результативным и одним факторным признаком при фиксированном значении других факторных признаков; г) зависимость между качественными признаками.	ОПК - 2	У2												
75.	Укажите способы преодоления мультиколлинеарности во множественной регрессии: а) исключение из модели одного или нескольких факторов; б) изменение линейной модели на степенную; в) переход от исходных переменных к их логарифмам; г) включение в линейное уравнение слагаемых вида $x_i \cdot x_j$.	ОПК - 2	У2												
76.	При отборе факторов в уравнение множественной регрессии используют: а) метод наименьших квадратов; б) метод исключения переменных; в) метод включения дополнительной переменной.	ОПК - 2	У2												
77.	Среди предложенных уравнений множественной регрессии укажите уравнение, в котором все коэффициенты регрессии незначимы по t-критерию Стьюдента (критическое значение считать равным 2). а) $\hat{y} = 25 + 5x_1 + 3x_2 + 4x_3$, где $t_{x_1} = 4$, $t_{x_2} = 1,3$, $t_{x_3} = 6$; б) $\hat{y} = 25 + 0,5x_1 + 0,3x_2 + 0,4x_3$, где $t_{x_1} = 1,4$, $t_{x_2} = 1,3$, $t_{x_3} = 6$; в) $\hat{y} = -25 + 5x_1 - 3x_2 + 4x_3$, где $t_{x_1} = -0,4$, $t_{x_2} = 1,3$, $t_{x_3} = 1,6$.	ОПК - 2	У2												
78.	При верификации уравнения множественной регрессии получены данные для проверки гипотезы о значимости коэффициентов регрессии по t-критерию Стьюдента. <table border="1" data-bbox="220 1518 935 1619"> <tr> <td></td><td>x_1</td><td>x_2</td><td>x_3</td></tr> <tr> <td>$t_{\text{расч}}$</td><td>11,99</td><td>-2,41</td><td>0,60</td></tr> <tr> <td>$t_{\text{крит}}$</td><td colspan="3">2,228138842</td></tr> </table> Какой фактор не должен присутствовать в регрессионной модели? а) x_1; б) x_2 ; в) x_3 .		x_1	x_2	x_3	$t_{\text{расч}}$	11,99	-2,41	0,60	$t_{\text{крит}}$	2,228138842			ОПК - 2	У2
	x_1	x_2	x_3												
$t_{\text{расч}}$	11,99	-2,41	0,60												
$t_{\text{крит}}$	2,228138842														
79.	При исследовании спроса на мясо получено уравнение $\hat{y} = 0,82x_1^{-2,63} \cdot x_2^{1,11}$, где x_1 – цена, x_2 – доход. Укажите верный вывод. а) рост цен на 1 % при том же доходе вызывает снижение спроса на 2,63 %; б) рост дохода на 1 % при той же цене вызывает снижение спроса на 1,11 %;	ОПК - 2	У2												

	в) рост цен на 1 денежную единицу при том же доходе вызывает снижение спроса в 2,63 раза; г) рост дохода на одну тысячу при той же цене вызывает повышение спроса в 1,1 раза.		
80.	В производственных функциях широко распространена степенная форма множественной регрессии $\tilde{y} = a \cdot x_1^{b_1} \cdot x_2^{b_2} \cdot \dots \cdot x_k^{b_k}.$ Укажите экономический смысл коэффициентов b_i : а) Они характеризуют среднее изменение результата с изменением соответствующего фактора на единицу при неизменном значении других факторов, закрепленных на среднем уровне. б) Они показывают, на сколько процентов в среднем изменяется результат с изменением соответствующего фактора на 1 % неизменности действия других факторов. в) Они позволяют однозначно ответить на вопрос о количественной взаимосвязи рассматриваемых признаков и целесообразности включения фактора в модель.	ОПК - 2	У2
81.	81. Скорректированный коэффициент детерминации: а) меньше обычного коэффициента детерминации; б) больше обычного коэффициента детерминации; в) меньше или равен обычному коэффициенту детерминации.	ОПК - 2	У2
82.	С увеличением числа объясняющих переменных скорректированный коэффициент детерминации: а) увеличивается; б) уменьшается; в) не изменяется.	ОПК - 2	У2
83.	Для построения модели линейной множественной регрессии вида $y = a + b_1x_1 + b_2x_2$ необходимое количество наблюдений должно быть: а) не более 10; б) не менее 7; в) не более 14; г) не менее 14	ОПК - 2	У2
84.	Частный коэффициент корреляции оценивает: а) тесноту связи между двумя переменными; б) тесноту связи между двумя переменными; в) тесноту связи между двумя переменными при фиксированном значении остальных факторов.	ОПК - 2	У3
85.	Уровни временного ряда могут формироваться под воздействием: а) случайных факторов; б) факторов, определяющих общую тенденцию; в) независимых факторов; г) эндогенных факторов.	ОПК - 2	У3
86.	Коэффициент автокорреляции временного ряда: а) характеризует тесноту линейной связи текущего и	ОПК - 2	У3

	предыдущего уровней ряда; б) характеризует тесноту нелинейной связи текущего и предыдущего уровней ряда; в) характеризует наличие или отсутствие тенденции.								
87.	Аддитивная модель временного ряда строится, если: а) значения сезонной компоненты предполагаются постоянными для различных циклов; б) амплитуда сезонных колебаний возрастает или уменьшается; в) отсутствует тенденция.	ОПК - 2	УЗ						
88.	Мультипликативная модель временного ряда строится, если: а) значения сезонной компоненты предполагаются постоянными для различных циклов; б) амплитуда сезонных колебаний возрастает или уменьшается; в) отсутствует тенденция.	ОПК - 2	УЗ						
89.	Аддитивная модель ряда динамики имеет структуру: а) $y_t = T + S + E$; б) $y_t = T \cdot S \cdot E$; в) $y_t = T + S \cdot E$; г) $y_t = T \cdot S + E$.	ОПК - 2	УЗ						
90.	Мультипликативная модель ряда динамики имеет вид: а) $y_t = T + S + E$; б) $y_t = T \cdot S \cdot E$; в) $y_t = T + S \cdot E$; г) $y_t = T \cdot S + E$.	ОПК - 2	УЗ						
91.	. На основе поквартальных данных построена аддитивная модель временного ряда. Скорректированные значения сезонной компоненты за первые три квартала равны: <table border="1"><tr><td><i>I квартал</i></td><td><i>II квартал</i></td><td><i>III квартал</i></td></tr><tr><td>7</td><td>9</td><td>-11</td></tr></table> Значение сезонной компоненты за IV квартал равно: а) 5; б) -4; в) -5.	<i>I квартал</i>	<i>II квартал</i>	<i>III квартал</i>	7	9	-11	ОПК - 2	УЗ
<i>I квартал</i>	<i>II квартал</i>	<i>III квартал</i>							
7	9	-11							
92.	На основе поквартальных данных построена мультипликативная модель временного ряда. Скорректированные значения сезонной компоненты за первые три квартала равны: <table border="1"><tr><td><i>I квартал</i></td><td><i>II квартал</i></td><td><i>III квартал</i></td></tr><tr><td>0,8</td><td>1,2</td><td>1,3</td></tr></table> Значение сезонной компоненты за IV квартал есть: а) 0,7; б) 1,7; в) 0,9.	<i>I квартал</i>	<i>II квартал</i>	<i>III квартал</i>	0,8	1,2	1,3	ОПК - 2	УЗ
<i>I квартал</i>	<i>II квартал</i>	<i>III квартал</i>							
0,8	1,2	1,3							
93.	При анализе автокорреляции уровней временного ряда для обеспечения статистической достоверности максимальный порядок коэффициентов автокорреляции должен быть: а) не больше числа наблюдений n ; б) не больше числа $n-4$; в) не больше числа $n/4$ /	ОПК - 2	УЗ						
94.	При расчете коэффициентов автокорреляции уровней временного ряда получены результаты:	ОПК - 2	УЗ						

	<table><tr><td>r_1</td><td>r_2</td><td>r_3</td><td>r_4</td><td>r_5</td><td>r_6</td><td>r_7</td><td>r_8</td></tr><tr><td>0,78</td><td>0,22</td><td>0,16</td><td>0,98</td><td>0,11</td><td>0,68</td><td>0,003</td><td>0,97</td></tr></table> Укажите верные утверждения: а) временной ряд содержит сильную нелинейную тенденцию; б) временной ряд содержит сильную линейную тенденцию; в) временной ряд содержит циклические колебания с циклом, равным четырем периодам времени; г) временной ряд содержит циклические колебания с циклом, равным семи периодам времени.	r_1	r_2	r_3	r_4	r_5	r_6	r_7	r_8	0,78	0,22	0,16	0,98	0,11	0,68	0,003	0,97		
r_1	r_2	r_3	r_4	r_5	r_6	r_7	r_8												
0,78	0,22	0,16	0,98	0,11	0,68	0,003	0,97												
95.	При расчете коэффициентов автокорреляции уровней временного ряда получены результаты: <table><tr><td>r_1</td><td>r_2</td><td>r_3</td><td>r_4</td><td>r_5</td><td>r_6</td><td>r_7</td></tr><tr><td>0,98</td><td>0,22</td><td>0,16</td><td>0,08</td><td>0,11</td><td>0,048</td><td>0,003</td></tr></table> Укажите верные утверждения: а) временной ряд содержит сильную нелинейную тенденцию; б) временной ряд содержит сильную линейную тенденцию; в) временной ряд содержит циклические колебания .	r_1	r_2	r_3	r_4	r_5	r_6	r_7	0,98	0,22	0,16	0,08	0,11	0,048	0,003	ОПК - 2	У3		
r_1	r_2	r_3	r_4	r_5	r_6	r_7													
0,98	0,22	0,16	0,08	0,11	0,048	0,003													
96.	Последовательность коэффициентов автокорреляции возрастающего порядка называют: а) коррелограммой; б) критерием Дарбина-Уотсона; в) автокорреляционной функцией.	ОПК - 2	У3																
97.	Корреляционную зависимость между последовательными уровнями временного ряда называют: а) смещенностью уровней ряда; б) автокорреляцией уровней ряда; в) гомокедастичностью уровней ряда.	ОПК - 2	У3																
98.	Укажите формулу для расчета коэффициента автокорреляции первого порядка для уровней ряда: а) $\frac{\sum_{t=2}^n (y_t - \bar{y}_1) \cdot (y_{t-1} - \bar{y}_2)}{\sqrt{\sum_{t=2}^n (y_t - \bar{y}_1)^2 \cdot \sum_{t=2}^n (y_{t-1} - \bar{y}_2)^2}}$; б) $\frac{\sum_{t=3}^n (y_t - \bar{y}_3) \cdot (y_{t-2} - \bar{y}_4)}{\sqrt{\sum_{t=3}^n (y_t - \bar{y}_3)^2 \cdot \sum_{t=3}^n (y_{t-2} - \bar{y}_4)^2}}$; в) $\frac{\sum (x - \bar{x}) \cdot (y - \bar{y})}{\sqrt{\sum (x - \bar{x})^2 \cdot \sum (y - \bar{y})^2}}$.	ОПК - 2	У3																
99.	С увеличением лага число пар значений, по которым рассчитывается коэффициент автокорреляции а) увеличивается; б) уменьшается; в) не изменяется.	ОПК - 2	У3																
100	Укажите способы определения типа тенденции временного ряда: а) качественный анализ изучаемого процесса; б) построение и визуальный анализ графика; в) применение статистических критериев; г) анализ автокорреляционной функции.	ОПК - 2	У3																
101	Укажите правильную функцию логарифмического тренда:	ОПК - 2	У3																

	а) $\tilde{y}_t = a + b \cdot \ln t$; б) $\tilde{y}_t = y_{\min} + \frac{y_{\max} - y_{\min}}{e^{a+b \ln t} + 1}$; в) $\tilde{y}_t = a + b_1 t + b_2 t^2$; г) $\tilde{y}_t = \frac{1}{e^{a+bt} + 1}$.		
102	Укажите правильную функцию логистического тренда: а) $\tilde{y}_t = a + \frac{b}{t}$; б) $\tilde{y}_t = y_{\min} + \frac{y_{\max} - y_{\min}}{e^{a+b \ln t} - 1}$; в) $\tilde{y}_t = a \cdot b^t$; г) $\tilde{y}_t = \frac{1}{e^{a+bt} + 1}$.	ОПК - 2	УЗ
103	Укажите правильную формулу расчета коэффициента b для линейного тренда $y_t = a + bt$: а) $b = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n y_i$; б) $b = \frac{\sum_{i=1}^n y_i \cdot t_i}{\sum_{i=1}^n t_i^2}$; в) $b = \frac{\sum_{i=1}^n y_i \cdot t_i^2}{\sum_{i=1}^n t_i^2}$; г) $b = \sum_{i=1}^n t_i$.	ОПК - 2	УЗ
104	Уравнение тренда имеет вид $y_t = 32,5 - 4,6t$. Насколько в среднем в исследуемом периоде изменяется результативный признак: а) увеличивается на 32,5; б) увеличивается на 4,6; в) уменьшается на 4,6; г) уменьшается на 32,5.	ОПК - 2	УЗ
105	Укажите правильную характеристику параметра a линейного тренда $y_t = a + bt$: а) среднее изменение анализируемого явления от одного момента времени к следующему; б) среднее ускорение изменения анализируемого явления от одного момента времени к следующему; в) средний выравненный уровень ряда для момента времени, принятого за начало отсчета; г) постоянный цепной темп изменения уровней временного ряда.	ОПК - 2	Н1
106	Укажите правильную характеристику параметра b экспоненциального тренда $y_t = a \cdot b^t$: а) среднее изменение анализируемого явления от одного момента времени к следующему; б) среднее ускорение изменения анализируемого явления от одного момента времени к следующему; в) средний выравненный уровень ряда для момента времени,	ОПК - 2	31

	принятого за начало отсчета; г) постоянный цепной темп изменения уровней временного ряда.		
107	Что характеризует коэффициент b_2 параболического тренда $y_t = a + b_1t + b_2t^2$? а) среднее изменение анализируемого явления от одного момента времени к следующему; б) среднее ускорение изменения анализируемого явления от одного момента времени к следующему; в) средний выравненный уровень ряда для момента времени, принятого за начало отсчета; г) постоянный цепной темп изменения уровней временного ряда.	ОПК - 2	32
108	Что характеризует коэффициент b линейного $y_t = a + bt$? а) среднее изменение анализируемого явления от одного момента времени к следующему; б) среднее ускорение изменения анализируемого явления от одного момента времени к следующему; в) средний выравненный уровень ряда для момента времени, принятого за начало отсчета; г) постоянный цепной темп изменения уровней временного ряда.	ОПК - 2	У1
109	Случайная составляющая в модели $y_t = T + S + E$ обозначена: а) T; б) S; в) E; г) y_t.	ОПК - 2	У2
110	Коррелирование отклонений от выравненных уровней тренда проводят а) для определения тесноты связи между отклонениями фактических уровней от выровненных, отражающих тренд; б) для определения тесноты связи между рядами динамики в случае отсутствия автокорреляции; в) для исключения влияния автокорреляции; г) для исключения влияния общей тенденции на колеблемость признака.	ОПК - 2	У3
111	Укажите методы уменьшения (устранения) автокорреляции во временных рядах: а) метод регрессионных преобразований; б) построения коррелограммы; в) метод включения дополнительного фактора; г) метод последовательных разностей.	ОПК - 2	Н1
112	Уровни временного ряда в эконометрическом анализе обозначают: а) x_t ; б) y_t ; в) ε_t ; г) ct .	ОПК - 2	Н1
113	Количественно ее можно измерить с помощью линейного		Н1

	коэффициента корреляции между уровнями исходного временного ряда и уровнями этого ряда, сдвинутыми на несколько шагов во времени. О какой характеристике временного ряда идет речь? а) о тенденции временного ряда; б) о сезонной составляющей ряда; в) об автокорреляции уровней ряда; г) о случайной составляющей временного ряда	ОПК - 2											
114	Что называют аналитическим выравниванием временного ряда? а) анализ автокорреляционной функции и коррелограммы; б) построение аналитической функции, характеризующей зависимость уровней ряда от времени, или тренда; в) устранение сезонной компоненты; г) применение методики скользящего выравнивания ряда.	ОПК - 2	Н1										
115	Укажите среди нижеперечисленного метод, не являющийся методом исключения тенденции во временных рядах: а) метод отклонений от тренда; б) метод скользящего выравнивания; в) метод последовательных разностей; г) включение в модель фактора времени.	ОПК - 2	Н1										
116	Построена аддитивная модель временного ряда с линейным трендом и сезонными колебаниями в 4 квартала. Сделать прогноз для 13 квартала от начала наблюдений: <table><tr><td>Уравнение тренда</td><td>$T = 5,715 + 0,186 \cdot t$</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Сезонная компонента по кварталам</td><td>$S_1 = 0,581$</td><td>$S_2 = -1,979$</td><td>$S_3 = -1,294$</td><td>$S_4 = 2,69$</td></tr></table> а) $y_{13} = 5,715 + 0,186 \cdot 13 - 1,294$; б) $y_{13} = (5,715 + 0,186 \cdot 13) \cdot (-1,294)$; в) $y_{13} = 5,715 + 0,186 \cdot 13 + 0,581$; г) $y_{13} = (5,715 + 0,186 \cdot 13) \cdot 0,581$	Уравнение тренда	$T = 5,715 + 0,186 \cdot t$				Сезонная компонента по кварталам	$S_1 = 0,581$	$S_2 = -1,979$	$S_3 = -1,294$	$S_4 = 2,69$	ОПК - 2	Н1
Уравнение тренда	$T = 5,715 + 0,186 \cdot t$												
Сезонная компонента по кварталам	$S_1 = 0,581$	$S_2 = -1,979$	$S_3 = -1,294$	$S_4 = 2,69$									
117	Построена мультипликативная модель временного ряда с экспоненциальным трендом и сезонными колебаниями в 4 года. Сделать прогноз для 9 года от начала наблюдений. <table><tr><td>Уравнение тренда</td><td>$T = 90,59 - 2,773 \cdot t$</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Сезонная компонента по годам</td><td>$S_1 = 0,913$</td><td>$S_2 = 1,202$</td><td>$S_3 = 1,082$</td><td>$S_4 = 0,803$</td></tr></table> а) $y_{15} = 90,59 - 2,773 \cdot 15 + 1,082$; б) $y_{15} = (90,59 - 2,773 \cdot 15) \cdot 1,082$; в) $y_{15} = (90,59 - 2,773 \cdot 15) : 1,082$; г) $y_{15} = 90,59 - 2,773 \cdot 15 \cdot 1,082$.	Уравнение тренда	$T = 90,59 - 2,773 \cdot t$				Сезонная компонента по годам	$S_1 = 0,913$	$S_2 = 1,202$	$S_3 = 1,082$	$S_4 = 0,803$	ОПК - 2	Н1
Уравнение тренда	$T = 90,59 - 2,773 \cdot t$												
Сезонная компонента по годам	$S_1 = 0,913$	$S_2 = 1,202$	$S_3 = 1,082$	$S_4 = 0,803$									
118	Динамическая модель отличается от других видов эконометрических моделей тем, что в такой модели: а) в данный момент времени учитывают значения входящих в нее переменных, относящихся к текущему времени; б) в данный момент времени учитывают значения входящих в нее переменных, относящихся к текущему и к предыдущему моментам времени.	ОПК - 2	Н1										
119	Лаговые значения переменных непосредственно включены в модель: а) авторегрессии;	ОПК - 2	Н1										

	б) адаптивных ожиданий; в) с распределенным лагом; г) неполной (частичной) корректировки.		
120	Модели авторегрессии характеризуются тем, что они: а) содержат в качестве факторных переменных лаговые значения результативного признака; б) учитывают желаемое значение факторного признака в период (t+1); в) учитывают желаемое (ожидаемое) значение результативного признака в период (t+1).	ОПК - 2	Н1
121	Этот коэффициент характеризует среднее абсолютное изменение y_t при изменении x_t на 1 единицу своего измерения в некоторый фиксированный момент времени t , без учета воздействия лаговых значений фактора x . Этот коэффициент называют: а) краткосрочным мультипликатором; б) долгосрочным мультипликатором; в) промежуточным мультипликатором.	ОПК - 2	Н1
122	Для некоторой модели адаптивных ожиданий в процессе преобразований получен механизм формирования ожиданий $x_{t+1} = 0,76x_t + (1-0,76)x^*t$. Как ожидаемое значение x_{t+1} адаптируется к предыдущим реальным значениям? а) не зависит от реальных значений; б) медленно; в) быстро.	ОПК - 2	Н1
123	В результате анализа фактических данных получена модель авторегрессии $y_t = 3 + 100y_{t-1} + 20x_t + \varepsilon_t$. Общее абсолютное изменение результата в момент времени (t+1) равно: а) 2000; б) 300; в) 60; г) 6000	ОПК - 2	Н1
124	Результативный признак зависит от ожидаемых значений факторного признака: а) в краткосрочной модели функции адаптивных ожиданий; б) в долгосрочной функции модели частичной корректировки; в) в краткосрочной функции модели частичной корректировки; г) в долгосрочной модели функции адаптивных ожиданий.	ОПК - 2	Н1
125	Для некоторой модели частичной корректировки механизм формирования ожиданий получен в виде равенства $y_t = y_{t-1} + \eta t$. Это позволяет сделать вывод о том, что: а) корректировка проходит быстро; б) корректировка происходит за один период; в) корректировка не происходит; г) корректировка происходит медленно.	ОПК - 2	Н1
126	Как называются модели временных данных в эконометрике, объясняющие поведение результативного признака в зависимости от предыдущих значений факторных переменных? а) модели ожиданий; б) модели авторегрессий;	ОПК - 2	Н2

	в) модели с распределенным лагом; г) модели стационарных рядов; д) модели нестационарных рядов.																																					
127	Как называются модели временных данных в эконометрике, объясняющие поведение результативного признака в зависимости от будущих значений факторных или результативных переменных? а) модели ожиданий; б) модели авторегрессий; в) модели с распределенным лагом; г) модели стационарных рядов; д) модели нестационарных рядов.	ОПК - 2	Н2																																			
128	Проблема спецификации регрессионной модели включает в себя а) отбор факторов, включаемых в уравнение регрессии; б) оценка параметров уравнения регрессии; в) оценка надежности результатов регрессионного анализа; г) выбор вида уравнения регрессии.	ОПК - 2	Н2																																			
129	Дана матрица парных коэффициентов корреляции: <table><tr><td></td><td>y</td><td>x₁</td><td>x₂</td><td>x₃</td></tr><tr><td>y</td><td>1</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>x₁</td><td>0,72</td><td>1</td><td></td><td></td></tr><tr><td>x₂</td><td>0,48</td><td>-0,02</td><td>1</td><td></td></tr><tr><td>x₃</td><td>0,13</td><td>0,69</td><td>0,51</td><td>1</td></tr></table> Наибольшее значение межфакторной корреляции равно ...		y	x ₁	x ₂	x ₃	y	1				x ₁	0,72	1			x ₂	0,48	-0,02	1		x ₃	0,13	0,69	0,51	1	ОПК - 2	Н2										
	y	x ₁	x ₂	x ₃																																		
y	1																																					
x ₁	0,72	1																																				
x ₂	0,48	-0,02	1																																			
x ₃	0,13	0,69	0,51	1																																		
130	Дана матрица парных коэффициентов корреляции: <table><tr><td></td><td>y</td><td>x₁</td><td>x₂</td><td>x₃</td></tr><tr><td>y</td><td>1</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>x₁</td><td>0,72</td><td>1</td><td></td><td></td></tr><tr><td>x₂</td><td>0,48</td><td>0,11</td><td>1</td><td></td></tr><tr><td>x₃</td><td>-0,21</td><td>-0,79</td><td>-0,51</td><td>1</td></tr></table> Установите соответствие а) связь прямая и сильная б) связь прямая и слабая в) связь обратная и сильная г) связь обратная и слабая 1) x ₁ , x ₂ 2) x ₁ , x ₃ 3) y, x ₁ 4) y, x ₂ 5) x ₂ , x ₃ 6) y, x ₃		y	x ₁	x ₂	x ₃	y	1				x ₁	0,72	1			x ₂	0,48	0,11	1		x ₃	-0,21	-0,79	-0,51	1	ОПК - 2	Н2										
	y	x ₁	x ₂	x ₃																																		
y	1																																					
x ₁	0,72	1																																				
x ₂	0,48	0,11	1																																			
x ₃	-0,21	-0,79	-0,51	1																																		
131	Изучается зависимость себестоимости единицы изделия (у, тыс. руб.) от величины выпуска продукции (х, тыс. шт.) по группам предприятий за отчетный период. Экономист обследовал n=5 предприятий и получил следующие результаты, представленные в таблице: <table><tr><td>Номер</td><td>x</td><td>y</td><td>x²</td><td>xy</td></tr><tr><td>1</td><td>2</td><td>1,9</td><td>4</td><td>3,8</td></tr><tr><td>2</td><td>3</td><td>1,7</td><td>9</td><td>5,1</td></tr><tr><td>3</td><td>4</td><td>1,8</td><td>16</td><td>7,2</td></tr><tr><td>4</td><td>5</td><td>1,6</td><td>25</td><td>8</td></tr><tr><td>5</td><td>6</td><td>1,4</td><td>36</td><td>8,4</td></tr><tr><td>Сумма</td><td>20</td><td>8,4</td><td>90</td><td>32,5</td></tr></table> Параметр a в уравнении линейной парной регрессии y = a – 0,11x + ε равен ...	Номер	x	y	x ²	xy	1	2	1,9	4	3,8	2	3	1,7	9	5,1	3	4	1,8	16	7,2	4	5	1,6	25	8	5	6	1,4	36	8,4	Сумма	20	8,4	90	32,5	ОПК - 2	Н2
Номер	x	y	x ²	xy																																		
1	2	1,9	4	3,8																																		
2	3	1,7	9	5,1																																		
3	4	1,8	16	7,2																																		
4	5	1,6	25	8																																		
5	6	1,4	36	8,4																																		
Сумма	20	8,4	90	32,5																																		
132	Зависимость объема продаж у (д.е.) от расходов на рекламу х (д.е.) характеризуется по 12 предприятиям следующим образом: y = 10,6 + 0,6x + ε, r _{yx} = 0,83. Дайте интерпретацию коэффициенту регрессии а) 60% вариации объема продаж объясняется вариацией расходов на рекламу	ОПК - 2	Н2																																			

	б) 83% вариации объема продаж объясняется вариацией расходов на рекламу в) при увеличении расходов на рекламу на 1 д.е. объем продаж увеличивается на 0,83 д.е. г) при увеличении расходов на рекламу на 1 д.е. объем продаж увеличивается в среднем на 0,6 д.е. д) при увеличении объемов продаж на 1 д.е. расходы на рекламу увеличиваются в среднем на 10,6 д.е.		
133	Верные утверждения относительно мультиколлинеарности факторов а) В модель линейной множественной регрессии рекомендуется включать мультиколлинеарные факторы; б) Мультиколлинеарность факторов приводит к снижению надежности оценок параметров уравнения регрессии; в) Мультиколлинеарность факторов проявляется в наличии парных коэффициентов межфакторной корреляции со значениями, большими 0,7; г) Мультиколлинеарность факторов проявляется в наличии парных коэффициентов межфакторной корреляции со значениями, меньшими 0,3.	ОПК - 2	Н2
134	Верные утверждения о включении в уравнение линейной множественной регрессии факторов а) включение фактора в модель приводит к заметному возрастанию коэффициента множественной детерминации; б) коэффициент парной корреляции для фактора и результативной переменной меньше 0,3; в) значение t-критерия Стьюдента для коэффициента регрессии при факторе меньше табличного значения; г) фактор должен объяснять поведение изучаемого показателя согласно принятым положениям экономической теории.	ОПК - 2	Н2
135	При построении модели множественной регрессии методом пошагового включения переменных на первом этапе рассматривается модель с ... а) одной объясняющей переменной, которая имеет с зависимой переменной наименьший коэффициент корреляции б) одной объясняющей переменной, которая имеет с зависимой переменной наибольший коэффициент корреляции в) несколькими объясняющими переменными, которые имеют с зависимой переменной коэффициенты корреляции по модулю больше 0,5 г) полным перечнем объясняющих переменных.	ОПК - 2	Н2
136	По 19 предприятиям оптовой торговли изучается зависимость объема реализации (y) от размера торговой площади (x1) и товарных запасов (x2). Получены следующие результаты: Коэффициент детерминации позволяет сделать вывод:	ОПК - 2	Н2

	а) связь между результативной переменной и факторами, включенными в модель, прямая и очень сильная б) 92% вариации объема реализации объясняется вариацией торговой площади и товарных запасов, а остальные 8% - не включенными в модель факторами в) на уровне значимости 8% уравнение регрессии в целом можно признать статистически значимым г) при увеличении факторов на 1 единицу объем реализации увеличивается в среднем на 92%.		
137	К свойствам уравнения регрессии в стандартизированном виде относятся ... а) коэффициенты регрессии при объясняющих переменных равны между собой; б) постоянный параметр (свободный член уравнения) регрессии отсутствует; в) стандартизированные коэффициенты регрессии несравнимы между собой; г) входящие в состав уравнения переменные являются безразмерными.	ОПК - 2	Н2
138	Коэффициент множественной детерминации характеризует а) тесноту совместного влияния факторов на результат в уравнении линейной множественной регрессии; б) тесноту связи между результатом и соответствующим фактором, при устранении влияния других факторов, включенных в модель; в) долю дисперсии результативного признака, объясненную регрессией в его общей дисперсии; г) среднее изменение результативной переменной с изменением соответствующего фактора на единицу, при неизменном значении других факторов, закрепленных на среднем уровне.	ОПК - 2	Н2
139	Для устранения систематической ошибки остаточной дисперсии для оценки качества модели линейной множественной регрессии используется а) коэффициент множественной детерминации; б) коэффициент множественной корреляции; в) скорректированный коэффициент множественной детерминации; д) скорректированный коэффициент частной корреляции.	ОПК - 2	Н2
140	При оценке статистической значимости параметра β_1 уравнения линейной множественной регрессии было получено расчетное значение t-статистики Стьюдента: Табличные значения t-статистики Стьюдента составили: $t = 3,5$ (для уровня значимости 0,01) $t = 2,36$ (для уровня значимости 0,05) $t = 1,86$ (для уровня значимости 0,1) Сделайте выводы о значимости коэффициента:	ОПК - 2	Н2

	а) параметр является статистически значимым с вероятностью 99%; б) параметр является статистически значимым с вероятностью 95%; в) параметр является статистически значимым с вероятностью 90%; г) параметр не является статистически значимым.																																																														
141	Получены результаты регрессионного анализа: <table><tr><th colspan="5">Вывод итогов</th></tr><tr><th colspan="5">Регрессионная статистика</th></tr><tr><td>Множественный R</td><td>0,890538364</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>R-квадрат</td><td>0,793058577</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Нормированный R-кв</td><td>0,749491962</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Стандартная ошибка</td><td>1,139093192</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><td>Наблюдения</td><td>24</td><td></td><td></td><td></td></tr><tr><th colspan="5">Дисперсионный анализ</th></tr><tr><th></th><th>df</th><th>SS</th><th>MS</th><th>F</th></tr><tr><td>Регрессия</td><td>4</td><td>94,47783849</td><td>23,61945962</td><td>18,20335526</td></tr><tr><td>Остаток</td><td>19</td><td>24,6531327</td><td>1,2975333</td><td></td></tr><tr><td>Итого</td><td>23</td><td>119,1309712</td><td></td><td></td></tr></table> Укажите верные выводы: а) между результативной переменной и факторами, включенными в модель, высокая множественная корреляция; б) 89% вариации результативной переменной объясняется вариацией включенных в модель факторов; в) уравнение регрессии в целом можно признать статистически значимым с вероятностью более 99%; г) Уравнение регрессии в целом можно признать статистически значимым с вероятностью не более 97,3%; д) доля регрессионной суммы квадратов в общей сумме квадратов равна 0,75.	Вывод итогов					Регрессионная статистика					Множественный R	0,890538364				R-квадрат	0,793058577				Нормированный R-кв	0,749491962				Стандартная ошибка	1,139093192				Наблюдения	24				Дисперсионный анализ						df	SS	MS	F	Регрессия	4	94,47783849	23,61945962	18,20335526	Остаток	19	24,6531327	1,2975333		Итого	23	119,1309712			ОПК - 2	Н2
Вывод итогов																																																															
Регрессионная статистика																																																															
Множественный R	0,890538364																																																														
R-квадрат	0,793058577																																																														
Нормированный R-кв	0,749491962																																																														
Стандартная ошибка	1,139093192																																																														
Наблюдения	24																																																														
Дисперсионный анализ																																																															
	df	SS	MS	F																																																											
Регрессия	4	94,47783849	23,61945962	18,20335526																																																											
Остаток	19	24,6531327	1,2975333																																																												
Итого	23	119,1309712																																																													
142	Получены результаты регрессионного анализа: <table><tr><th></th><th>Коэффициент</th><th>стандартная ошибка</th><th>t-статистика</th><th>P-Значение</th><th>Нижние 95%</th><th>Верхние 95%</th></tr><tr><td>У-пересечение</td><td>4,701125083</td><td>3,494625193</td><td>1,345244432</td><td>0,194383582</td><td>-2,613209491</td><td>12,01545966</td></tr><tr><td>Переменная X 1</td><td>0,356998036</td><td>0,137220372</td><td>2,601640188</td><td>0,01752378</td><td>0,069792496</td><td>0,644203575</td></tr><tr><td>Переменная X 2</td><td>-0,027978184</td><td>0,008492678</td><td>-3,294389051</td><td>0,00381324</td><td>-0,045733563</td><td>-0,010202806</td></tr><tr><td>Переменная X 3</td><td>0,039961897</td><td>0,047285827</td><td>0,845113647</td><td>0,408564009</td><td>-0,059008475</td><td>0,13893227</td></tr><tr><td>Переменная X 4</td><td>-2,924166879</td><td>0,638316057</td><td>-4,581064264</td><td>0,000204025</td><td>-4,260177739</td><td>-1,58815602</td></tr></table> Уравнение линейной множественной регрессии имеет вид: а. $y = 4,7 + 0.36x_1 - 0.03x_2 - 2.92x_4 + \varepsilon$ б. $y = 4,7 + 0.36x_1 - 0.03x_2 + 0.04x_3 - 2.92x_4 + \varepsilon$ с. $y = 1.35 + 2.6x_1 - 3.29x_2 + 0.85x_3 - 4.58x_4 + \varepsilon$ д. $y = 1.35 + 2.6x_1 - 3.29x_2 - 4.58x_4 + \varepsilon$ е. $y = 3.49 + 0.13x_1 + 0.008x_2 + 0.05x_3 + 0.64x_4 + \varepsilon$		Коэффициент	стандартная ошибка	t-статистика	P-Значение	Нижние 95%	Верхние 95%	У-пересечение	4,701125083	3,494625193	1,345244432	0,194383582	-2,613209491	12,01545966	Переменная X 1	0,356998036	0,137220372	2,601640188	0,01752378	0,069792496	0,644203575	Переменная X 2	-0,027978184	0,008492678	-3,294389051	0,00381324	-0,045733563	-0,010202806	Переменная X 3	0,039961897	0,047285827	0,845113647	0,408564009	-0,059008475	0,13893227	Переменная X 4	-2,924166879	0,638316057	-4,581064264	0,000204025	-4,260177739	-1,58815602	ОПК - 2	Н2																		
	Коэффициент	стандартная ошибка	t-статистика	P-Значение	Нижние 95%	Верхние 95%																																																									
У-пересечение	4,701125083	3,494625193	1,345244432	0,194383582	-2,613209491	12,01545966																																																									
Переменная X 1	0,356998036	0,137220372	2,601640188	0,01752378	0,069792496	0,644203575																																																									
Переменная X 2	-0,027978184	0,008492678	-3,294389051	0,00381324	-0,045733563	-0,010202806																																																									
Переменная X 3	0,039961897	0,047285827	0,845113647	0,408564009	-0,059008475	0,13893227																																																									
Переменная X 4	-2,924166879	0,638316057	-4,581064264	0,000204025	-4,260177739	-1,58815602																																																									
143	Предпосылками МНК являются... а) дисперсия случайных отклонений постоянна для всех наблюдений; б) дисперсия случайных отклонений не постоянна для всех наблюдений; в) случайные отклонения коррелируют друг с другом; г) случайные отклонения являются независимыми друг от друга.	ОПК - 2	Н2																																																												
144	При выполнении предпосылок метода наименьших квадратов (МНК) остатки уравнения регрессии, как правило, характеризуются... а) нулевой средней величиной; б) гетероскедстичностью; в) случайным характером;	ОПК - 2	Н2																																																												

	г) высокой степенью автокорреляции.		
145	В регрессионную модель урожайности пшеницы необходимо включить показатель качества почвы: 0 – черноземы; 1 – каштановые, подзолистые и дерново-глеевые почвы, 2 – песчаные, супесчаные, тяжелосуглинистые и глинистые почвы. Укажите фиктивные переменные, которые необходимо включить в модель а. $z_1 = \begin{cases} 1, \text{ если почва – чернозем,} \\ 0, \text{ в противном случае.} \end{cases}$ б. $z_2 = \begin{cases} 1, \text{ если почвы – каштановые, подзолистые,} \\ 0, \text{ в противном случае.} \end{cases}$ в. $z_3 = \begin{cases} 1, \text{ если почвы – песчаные, глинистые,} \\ 0, \text{ в противном случае.} \end{cases}$ г. $z_4 = \begin{cases} 1, \text{ если почвы – каштановые, подзолистые,} \\ 2, \text{ если почвы – песчаные, глинистые.} \end{cases}$	ОПК - 2	Н2
146	Укажите верные утверждения по поводу модели: $y = a + \frac{b}{x} + \varepsilon$ а) линейаризуется линейную модель множественной регрессии; б) линейаризуется линейную модель парной регрессии; в) относится к классу нелинейных моделей по объясняющим переменным, но линейных по оцениваемым параметрам; г) относится к классу линейных моделей;	ОПК - 2	Н2
147	Для получения оценок параметров степенной регрессионной модели ... а) метод наименьших квадратов неприменим; б) требуется подобрать соответствующую подстановку; в) необходимо выполнить логарифмическое преобразование; г) необходимо выполнить тригонометрическое преобразование.	ОПК - 2	Н2
148	Уравнение степенной функции имеет вид: а) $\tilde{y} = a \cdot x^b$; б) $\tilde{y} = a + \frac{b}{x}$; в) $\tilde{y} = a \cdot b^x$; г) $\tilde{y} = \frac{a}{1 + b \cdot e^{-cx}}$.	ОПК - 2	Н2
149	Индекс корреляции определяется по формуле: а) $\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n \left \frac{y_i - \tilde{y}_i}{y_i} \right \cdot 100\%$; б) $\sqrt{1 - \frac{\sum (y - \tilde{y})^2}{\sum (y - \bar{y})^2}}$; в) $\frac{\overline{xy} - \bar{x} \cdot \bar{y}}{\sigma_x \sigma_y}$; г) $\frac{r_{xy}^2}{1 - r_{xy}^2} (n - 2)$.	ОПК - 2	Н2
150	Какое из следующих уравнений нелинейно по оцениваемым параметрам:	ОПК - 2	Н2

а) $\tilde{y} = a + b \cdot \ln x$;		
б) $\tilde{y} = \frac{a}{1 + b \cdot e^{-cx}}$;		
в) $\tilde{y} = a + bx$;		
г) $\tilde{y} = a \cdot b^x$.		

5.3.2.2. Вопросы для устного опроса

№	Содержание	Компетенция	ИДК
1.	Сформулируйте определение эконометрики как науки на основе высказываний различных ученых.	ОПК - 2	31
2.	Сформулируйте задачи эконометрического исследования на современном этапе развития.	ОПК - 2	31
3.	Как выглядит линейная модель парной регрессии? Как называют переменные участвующие в модели?	ОПК - 2	31
4.	В чем заключается метод наименьших квадратов? Выведите формулы для расчета коэффициентов линейной парной регрессии по МНК.	ОПК - 2	32
5.	Сформулируйте условия и следствия теоремы Гаусса-Маркова.	ОПК - 2	32
6.	Дайте определение коэффициента детерминации.	ОПК - 2	32
7.	Как проверяется значимость коэффициентов регрессии?	ОПК - 2	У1
8.	От каких факторов зависит точность и надежность прогноза?	ОПК - 2	У1
9.	Напишите линейную модель регрессии с k-факторами.	ОПК - 2	У1
10.	Как получают систему нормальных уравнений в методе МНК? С какой целью составляется и решается система нормальных уравнений МНК?	ОПК - 2	У2
11.	Приведите формулу расчета коэффициентов регрессионного уравнения в методе наименьших квадратов.	ОПК - 2	У2
12.	Как оценивается качество уравнения регрессии с помощью абсолютной и относительной ошибки аппроксимации?	ОПК - 2	У2
13.	Дайте определение частного коэффициента корреляции и выясните его роль в процедуре шаговой регрессии последовательного включения (исключения) переменных.	ОПК - 2	У3
14.	В чем состоит проблема мультиколлинеарности факторов?	ОПК - 2	У3
15.	Какие переменные называются фиктивными, манекенными (dummy)? Чем вызвана необходимость использования фиктивных переменных?	ОПК - 2	У3
16.	Дайте определение гетероскедастичности наблюдений.	ОПК - 2	У3
17.	Опишите подходы к устранению гетероскедастичности основанные на преобразовании исходных данных.	ОПК - 2	У3
18.	Расскажите об основных принципах прогнозирования экономических процессов — системности, адекватности,	ОПК - 2	Н1

	альтернативности.		
19.	Что такое метод и модель прогнозирования?	ОПК - 2	Н1
20.	Что такое случайный процесс?	ОПК - 2	Н1
21.	Дайте определения стационарного в слабом смысле стохастического процесса.	ОПК - 2	Н1
22.	Как определяются автокорреляции временного ряда?	ОПК - 2	Н1
23.	Как записать АРСС(p,s) модель для стационарного временного ряда?	ОПК - 2	Н2
24.	Какие подходы можно использовать для выделения тренда нестационарного временного ряда?	ОПК - 2	Н2
25.	Какой общий вид линейного фильтра для временного ряда?	ОПК - 2	Н2
26.	Как строится простая скользящая средняя временного ряда?	ОПК - 2	Н2
27.	Опишите процесс простого экспоненциального сглаживания временного ряда.	ОПК - 2	Н2

5.3.2.3. Задачи для проверки умений и навыков

№	Содержание	Компе- тенци я	ИД К																																																																																																																
1.	Исследуйте зависимость урожайности зерновых культур (ц/га) от следующих факторов сельскохозяйственного производства: X_1 – число тракторов на 100 га; X_2 – число зерноуборочных комбайнов на 100 га; X_3 – число орудий поверхностной обработки почвы на 100 га; X_4 – количество удобрений, расходуемых на гектар (т/га); X_5 – количество химических средств защиты растений, расходуемых на гектар (ц/га). Исходные данные для 20 районов области приведены в табл. 1.2.3.4. <table><tr><th>Районы области</th><th>Y</th><th>X_1</th><th>X_2</th><th>X_3</th><th>X_4</th><th>X_5</th></tr><tr><td>-1-</td><td>-2-</td><td>-3-</td><td>-4-</td><td>-5-</td><td>-6-</td><td>-7-</td></tr><tr><td>1</td><td>9,7</td><td>1,59</td><td>0,26</td><td>2,05</td><td>0,32</td><td>0,14</td></tr><tr><td>2</td><td>8,4</td><td>0,34</td><td>0,28</td><td>0,46</td><td>0,59</td><td>0,66</td></tr><tr><td>3</td><td>9,0</td><td>2,53</td><td>0,31</td><td>2,46</td><td>0,30</td><td>0,31</td></tr><tr><td>4</td><td>9,9</td><td>4,63</td><td>0,40</td><td>6,44</td><td>0,43</td><td>0,59</td></tr><tr><td>5</td><td>9,6</td><td>2,16</td><td>0,26</td><td>2,16</td><td>0,39</td><td>0,16</td></tr><tr><td>6</td><td>8,6</td><td>2,16</td><td>0,30</td><td>2,69</td><td>0,32</td><td>0,17</td></tr></table> <table><tr><td>-1-</td><td>-2-</td><td>-3-</td><td>-4-</td><td>-5-</td><td>-6-</td><td>-7-</td></tr><tr><td>7</td><td>12,5</td><td>0,68</td><td>0,29</td><td>0,73</td><td>0,42</td><td>0,23</td></tr><tr><td>8</td><td>7,6</td><td>0,35</td><td>0,26</td><td>0,42</td><td>0,21</td><td>0,08</td></tr><tr><td>9</td><td>6,9</td><td>0,52</td><td>0,24</td><td>0,49</td><td>0,20</td><td>0,08</td></tr><tr><td>10</td><td>13,5</td><td>3,42</td><td>0,31</td><td>3,02</td><td>1,37</td><td>0,73</td></tr><tr><td>11</td><td>9,7</td><td>1,78</td><td>0,30</td><td>3,19</td><td>0,73</td><td>0,17</td></tr><tr><td>12</td><td>10,7</td><td>2,40</td><td>0,32</td><td>3,30</td><td>0,25</td><td>0,14</td></tr><tr><td>13</td><td>12,1</td><td>9,36</td><td>0,40</td><td>11,51</td><td>0,39</td><td>0,38</td></tr></table>	Районы области	Y	X_1	X_2	X_3	X_4	X_5	-1-	-2-	-3-	-4-	-5-	-6-	-7-	1	9,7	1,59	0,26	2,05	0,32	0,14	2	8,4	0,34	0,28	0,46	0,59	0,66	3	9,0	2,53	0,31	2,46	0,30	0,31	4	9,9	4,63	0,40	6,44	0,43	0,59	5	9,6	2,16	0,26	2,16	0,39	0,16	6	8,6	2,16	0,30	2,69	0,32	0,17	-1-	-2-	-3-	-4-	-5-	-6-	-7-	7	12,5	0,68	0,29	0,73	0,42	0,23	8	7,6	0,35	0,26	0,42	0,21	0,08	9	6,9	0,52	0,24	0,49	0,20	0,08	10	13,5	3,42	0,31	3,02	1,37	0,73	11	9,7	1,78	0,30	3,19	0,73	0,17	12	10,7	2,40	0,32	3,30	0,25	0,14	13	12,1	9,36	0,40	11,51	0,39	0,38	ОПК - 2	У1
Районы области	Y	X_1	X_2	X_3	X_4	X_5																																																																																																													
-1-	-2-	-3-	-4-	-5-	-6-	-7-																																																																																																													
1	9,7	1,59	0,26	2,05	0,32	0,14																																																																																																													
2	8,4	0,34	0,28	0,46	0,59	0,66																																																																																																													
3	9,0	2,53	0,31	2,46	0,30	0,31																																																																																																													
4	9,9	4,63	0,40	6,44	0,43	0,59																																																																																																													
5	9,6	2,16	0,26	2,16	0,39	0,16																																																																																																													
6	8,6	2,16	0,30	2,69	0,32	0,17																																																																																																													
-1-	-2-	-3-	-4-	-5-	-6-	-7-																																																																																																													
7	12,5	0,68	0,29	0,73	0,42	0,23																																																																																																													
8	7,6	0,35	0,26	0,42	0,21	0,08																																																																																																													
9	6,9	0,52	0,24	0,49	0,20	0,08																																																																																																													
10	13,5	3,42	0,31	3,02	1,37	0,73																																																																																																													
11	9,7	1,78	0,30	3,19	0,73	0,17																																																																																																													
12	10,7	2,40	0,32	3,30	0,25	0,14																																																																																																													
13	12,1	9,36	0,40	11,51	0,39	0,38																																																																																																													

	<table><tr><td>14</td><td>9,7</td><td>1,72</td><td>0,28</td><td>2,26</td><td>0,82</td><td>0,17</td></tr><tr><td>15</td><td>7,0</td><td>0,59</td><td>0,29</td><td>0,60</td><td>0,13</td><td>0,35</td></tr><tr><td>16</td><td>7,2</td><td>0,28</td><td>0,26</td><td>0,30</td><td>0,09</td><td>0,15</td></tr><tr><td>17</td><td>8,2</td><td>1,64</td><td>0,29</td><td>1,44</td><td>0,20</td><td>0,08</td></tr><tr><td>18</td><td>8,4</td><td>0,09</td><td>0,22</td><td>0,05</td><td>0,43</td><td>0,20</td></tr><tr><td>19</td><td>13,1</td><td>0,08</td><td>0,25</td><td>0,03</td><td>0,73</td><td>0,20</td></tr><tr><td>20</td><td>8,7</td><td>1,36</td><td>0,26</td><td>0,17</td><td>0,99</td><td>0,42</td></tr></table>	14	9,7	1,72	0,28	2,26	0,82	0,17	15	7,0	0,59	0,29	0,60	0,13	0,35	16	7,2	0,28	0,26	0,30	0,09	0,15	17	8,2	1,64	0,29	1,44	0,20	0,08	18	8,4	0,09	0,22	0,05	0,43	0,20	19	13,1	0,08	0,25	0,03	0,73	0,20	20	8,7	1,36	0,26	0,17	0,99	0,42		
14	9,7	1,72	0,28	2,26	0,82	0,17																																														
15	7,0	0,59	0,29	0,60	0,13	0,35																																														
16	7,2	0,28	0,26	0,30	0,09	0,15																																														
17	8,2	1,64	0,29	1,44	0,20	0,08																																														
18	8,4	0,09	0,22	0,05	0,43	0,20																																														
19	13,1	0,08	0,25	0,03	0,73	0,20																																														
20	8,7	1,36	0,26	0,17	0,99	0,42																																														
2.	Торговое предприятие «Альянс» имеет сеть, состоящую из 12 магазинов, информация о деятельности которых представлена в табл. 1.2.3.5. Постройте: 1. диаграммы рассеяния годового товарооборота (y) в зависимости от торговой площади (X_1) и среднего числа посетителей в день (X_2) и определите форму связи между результирующим показателем и каждым из этих факторов; 2. двухфакторное регрессионное уравнение, отражающее зависимость переменной y от соответствующих факторов X_1 и X_2. Оцените: 1) качество построенного уравнения; 2) частные коэффициенты эластичности годового товарооборота от торговой площади и от среднего числа посетителей.	ОПК - 2	У1																																																	
3.	Оценивается уравнение регрессии с двумя объясняющими переменными ($n = 15$) . При этом $RSS = 31,33$, $TSS = 50,4$. Проверьте гипотезу о значимости уравнения регрессии в целом. Найдите оценку дисперсии ошибки, коэффициент детерминации. Дайте интерпретацию полученным результатам.	ОПК - 2	У2																																																	
4	По 30 наблюдениям оценивается уравнение регрессии $y_t = b_0 + b_1x_{t1} + b_2x_{t2} + b_3x_{t3} + e$. Есть предположения, что модель будет более согласована с данными, если весь интервал наблюдений разбить на два подынтервала и оценивать регрессию для каждого из них. Это связано с некоторыми экономическими изменениями, произошедшими между 18 и 19 наблюдениями. Рассчитаны суммы квадратов остатков для общей выборки и подынтервалов: $ESS_0 = 59$, $ESS_1 = 27$, $ESS_2 = 15$. Проверить гипотезу о наличии структурного изменения.	ОПК - 2	У2																																																	
5	Оценивается регрессионная зависимость выпуска продукции обрабатывающей промышленности на душу населения M от валового внутреннего продукта на душу населения в этом же году G . Причем для шести стран с наименьшими значениями показателя G сумма квадратов отклонений составляет 20,523, а для шести стран с наибольшими значениями – 313,842. Выполните проверку на гетероскедастичность по критерию Голдфелда–Квандта.	ОПК - 2	У2																																																	
6	Оценивается регрессионная зависимость стоимости жилья в г.Минске от девяти факторов на основе 820 наблюдений. Для обнаружения гетероскедастичности выборка упорядочивается по стоимости квартир и находятся суммы квадратов остатков для первой и третьей подвыборок (четверть средних наблюдений исключена из анализа). Они составляют 3,2 и 1,7 соответственно. Проверьте предположение о наличии гетероскедастичности остатков модели.	ОПК - 2	У3																																																	
7	Модель логарифмической регрессии между расходами на жилье, располагаемым личным доходом и относительной ценой имеет	ОПК -	У3																																																	

	следующий вид: $\log y_t = 4,47 + 0,40 \log x_t - 0,26 \log p_t$, $R = 0,99$, $r^2 = 0,8$. $= 0,99$, $r^2 = 0,98$. Проверьте предположение о наличии автокорреляции остатков. Предложите процедуру оценивания модели в случае отклонения нулевой гипотезы.	2	
8	С целью изучения трудовой мобильности проводится выборочный опрос населения. Рассчитанный по ответам 400 респондентов средний стаж работы на текущем рабочем месте составил 2.2 года, а оценка дисперсии составила $\hat{\sigma}^2 = 4$. Рассчитайте 99% доверительный интервал для среднего стажа по генеральной совокупности.	ОПК - 2	У3
9	На кондитерской фабрике отдел контроля качества отобрал 25 плиток горького шоколада для проверки состава продукции. На основании анализа отобранных образцов был построен 90% доверительный интервал для среднего веса какао в составе одной плитки в граммах: [59.5; 62.5]. При расчёте интервала предполагалось, что вес какао имеет нормальное распределение с неизвестной дисперсией. Начальник отдела заявил, что хочет иметь более надёжные результаты и попросил рассчитать 95% доверительный интервал для среднего веса какао. Выполните просьбу начальника.	ОПК - 2	Н1
10	В течение двух дней проводился опрос населения города с целью определения отношения жителей к действующей администрации. В первый день было опрошено 256 человек. По этим наблюдениям статистик построил доверительный интервал для доли тех, кто выразил положительное отношение к работе администрации города: (31,57%; 43,43%). Во второй день были опрошены ещё 144 человека, из которых 46 выразили положительное отношение к работе администрации. а) Какой уровень доверия (доверительная вероятность) использовался при построении доверительного интервала по данным первого дня опроса? б) По данным за оба дня рассчитайте 90% доверительный интервал для доли населения, положительно относящегося к работе администрации.	ОПК - 2	Н1
11	По выборке из нормально распределённой генеральной совокупности объёмом в 16 наблюдений рассчитаны выборочное среднее $\bar{X} = 12.6$ и оценка для дисперсии $\hat{\sigma}^2 = 6.25$. Рассчитайте 90% доверительный интервал для математического ожидания и 80% доверительный интервал для дисперсии.	ОПК - 2	Н1
12	Производитель одежды хочет узнать, какой цвет футболок предпочитает целевая группа: малиновый или салатный. В выборке из 225 человек 90 высказались в пользу малинового цвета, а 135 – в пользу салатного. а) Рассчитайте 95% доверительный интервал для доли предпочитающих салатный цвет. б) Строгий начальник хочет, чтобы ширина доверительного интервала (разница между его	ОПК - 2	Н1

	верхней и нижней границей) была не больше 0.1. Какой доверительной вероятности можно добиться в таком случае?		
13	По ежегодным данным с 2000 по 2010 год (всего 11 наблюдений) оценивается тренд туристического потока из России в Финляндию с помощью $Tripst = \beta_1 + \beta_2 t + \varepsilon_t$. Здесь t – год, которому соответствует наблюдение ($t=0$ для 2000 года, $t=10$ для 2010 года), а $Tripst$ – число туристических поездок (в тысячах) российских граждан в Финляндию в году t. Вот результаты оценивания: $t = 278.8 + 40.4t$, $R = 0.7$, $TSS = 253000$. В скобках под оценками коэффициентов приведены их стандартные ошибки. а) Согласно оценённой модели, насколько в среднем увеличивается поток туристов из России в Финляндию за два года? б) Постройте 90% доверительный интервал для коэффициента β_2. в) Оцените дисперсию случайной составляющей ε_t.	ОПК - 2	H2
14	По ежегодным данным³ за 1975-1988 гг. (14 наблюдений) оценивалась зависимость цены на бензин (Petrol, центы за галлон) от цены на сырую нефть (Oil, доллары за баррель). Результаты оценивания приведены ниже: ^ $Petrol_i = 41.9 + 3.0 Oil_i$ Также известно, что $RSS=631.1$, а $TSS=12622$. Предполагается, что все предпосылки классической линейной нормальной регрессионной модели выполнены. а) Рассчитайте коэффициент детерминации R^2. б) Проверьте гипотезу о том, что рост цены на нефть на 1 долл. за баррель соответствует росту цены на бензин на 2 цента за галлон, используя уровень значимости 10%. в) В 1988 году цена на нефть составила 12.57 доллара за баррель. Какова была ожидаемая (прогнозируемая согласно имеющейся модели регрессии) цена на бензин? Какой должна быть цена на нефть, чтобы ожидаемая цена на бензин составила 100 центов за галлон?	ОПК - 2	H2
15	На рынке пирожков основным заменителем пирожков с капустой являются пирожки с картошкой. Исследователь, стараясь разобраться в механизмах ценообразования, оценивает регрессию $P_i = \beta_1 + \beta_2 C_i + \varepsilon_i$, где P_i – цена пирожка с картошкой у i-го продавца, а C_i – цена пирожка с капустой у того же продавца. Вот результат оценивания по 12 наблюдениям: $\hat{P}_i = 5.2 + 0.8 C_i$, $RSS = 23$ а) Найдите несмещённую оценку дисперсии случайной составляющей ε_i. б) Постройте 95% доверительный интервал для коэффициента β_2. в) Исследователь предполагает, что ожидаемая цена пирожка с картошкой у продавца, торгующего пирожками с капустой по 20	ОПК - 2	H2

	рублей, равна 22 рублям. Сформулируйте гипотезу исследователя в терминах коэффициентов регрессии.		
16	Рассчитанный по 20 наблюдениям за признаками X и Y выборочный коэффициент корреляции составил 0.5. Есть ли основания считать, что между признаками существует регрессионная зависимость? Сформулируйте основную и альтернативную гипотезы в терминах коэффициентов регрессии, проверку проведите на уровне значимости 5%.	ОПК - 2	H2

1.3.2.4. Перечень тем рефератов, контрольных, расчетно-графических работ Не предусмотрен

1.3.2.5. Вопросы для контрольной (расчетно-графической) работы Не предусмотрен

5.4. Система оценивания достижения компетенций

5.4.1. Оценка достижения компетенций в ходе промежуточной аттестации

3.1.1. Оценка достижений компетенции в ходе промежуточной аттестации			
Код	Содержание компетенций и индикаторов	Номера вопросов и задач	
		вопросы к экзамену	задачи к экзамену
ОПК – 2 Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач			
31	Знает современные методы экономического анализа, математической статистики и эконометрики	1-12	
32	Знает основные виды статистической информации	13-17	
У1	Умеет работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах	18-21	1-2
У2	Умеет использовать современные методы экономического анализа, математической статистики и эконометрики для решения прикладных задач	22-26	3-4
У3	Умеет составлять план и осуществлять статистические исследования реальной экономической ситуации с применением изученных методов	27-31	4-6
Н1	Имеет навыки применения статистических и математических методов и		

	моделей для решения поставленных экономических задач	32-36	7-9
H2	Иметь навыки работы с модулями статистических пакетов Excel и STATISTICA , позволяющие применить эконометрические методы оценивания.	37-40	10-12

5.4.2. Оценка достижения компетенций в ходе текущего контроля

ОПК – 2 Способен осуществлять сбор, обработку и статистический анализ данных, необходимых для решения поставленных экономических задач;				
Индикаторы достижения компетенции ПК-4		Номера вопросов и задач		
Код	Содержание	вопросы тестов	вопросы устного опроса	задачи для проверки умений и навыков
31	Знает современные методы экономического анализа, математической статистики и эконометрики	1-20	1-3	
32	Знает основные виды статистической информации	21-41	4-6	
У1	Умеет работать с национальными и международными базами данных с целью поиска необходимой информации об экономических явлениях и процессах	42-62	7-9	1-2
У2	Умеет использовать современные методы экономического анализа, математической статистики и эконометрики для решения прикладных задач	63-83	10-12	3-5
У3	Умеет составлять план и осуществлять статистические исследования реальной экономической ситуации с применением изученных методов	84-104	13-17	6-8
H1	Имеет навыки применения статистических и математических методов и моделей для решения поставленных экономических задач	105-125	18-22	9-12
H2	Иметь навыки работы с модулями статистических пакетов Excel и STATISTICA , позволяющие применить эконометрические методы оценивания.	126-150	23-27	13-16

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1. Рекомендуемая литература

Тип рекомендаций	Перечень и реквизиты литературы (автор, название, год и место издания)	Количество экз. в библиотеке
1	2	3
2.1. Учебные издания	Агаларов З. С. Эконометрика [электронный ресурс]: Учебник / З. С. Агаларов, А. И. Орлов - Москва: Издательско-торговая	-

Тип рекомендаций	Перечень и реквизиты литературы (автор, название, год и место издания)	Количество экз. в библиотеке
1	2	3
	корпорация "Дашков и К", 2021 - 380 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: http://znanium.com/catalog/document?id=371216	
	Кузнецова О. А. Эконометрика [Электронный ресурс]: практикум / Кузнецова О. А. - Самара: СамГУ, 2019 - 72 с. [ЭИ] [ЭБС Лань] URL: https://e.lanbook.com/book/148591	-
	Новиков А. И. Эконометрика [электронный ресурс]: Учебное пособие / А. И. Новиков - Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М", 2020 - 272 с. [ЭИ] [ЭБС Знаниум] URL: http://znanium.com/catalog/document?id=356022	-
	Черникова А. Е. Эконометрика (продвинутый уровень) [Электронный ресурс]: учебное пособие / Черникова А. Е. - Омск: СибАДИ, 2019 - 76 с. [ЭИ] [ЭБС Лань] URL: https://e.lanbook.com/book/149536	-
	Эконометрика [Электронный ресурс]: продвинутый уровень: учебное пособие для проведения лабораторных работ для направления 38.04.01 "Экономика" / [А. Г. Буховец и др.]; Воронежский государственный аграрный университет ; [под ред. А. Г. Буховца] - Воронеж: Воронежский государственный аграрный университет, 2018 [ПТ] URL: http://catalog.vsau.ru/elib/books/b146977.pdf	1
2.2. Методические издания	Эконометрика (продвинутый уровень) [Электронный ресурс]: методические рекомендации для самостоятельной работы по дисциплине для магистров направления подготовки: 38.04.01 «Экономика» направленность (профиль) «Корпоративный финансовый менеджмент» / Воронежский государственный аграрный университет ; [сост.: М. В. Горелова, Е. А. Сёмин] - Воронеж: Воронежский государственный аграрный университет, 2021 [ПТ] URL: http://catalog.vsau.ru/elib/metod/m165133.pdf	1
2.3. Периодические издания	Прикладная эконометрика: научно-практический журнал - Москва: Маркет ДС Корпорейшн, 2007-	1

6.2. Ресурсы сети Интернет

6.2.1. Электронные библиотечные системы

№	Название	Размещение
1	Лань	https://e.lanbook.com
2	ZNANIUM.COM	http://znanium.com/
3	ЮРАЙТ	http://www.biblio-online.ru/
4	IPRbooks	http://www.iprbookshop.ru/
5	E-library	https://elibrary.ru/
6	Электронная библиотека ВГАУ	http://library.vsau.ru/

6.2.2. Профессиональные базы данных и информационные системы

№	Название	Размещение
1	Справочная правовая система Гарант	http://www.consultant.ru/
2	Справочная правовая система Консультант Плюс	http://ivo.garant.ru
3	Профессиональные справочные системы «Кодекс»	https://техэксперт.сайт/sistema-kodeks

6.2.3. Сайты и информационные порталы

№	Название	Размещение
1	Компания StatSoft Russia занимается локализацией программных продуктов <i>STATISTICA</i> , технической поддержкой пользователей, а также оказывает широкий спектр консалтинговых услуг: обучение в Академии Анализа Данных StatSoft , разработка готовых отраслевых решений , исследования в различных областях применения статистики: маркетинге, промышленности, экономике/социологии, страховании и т.д.	http://www.statsoft.ru/
2	Система интеллектуального анализа финансового состояния организации по данным бухгалтерской и статистической отчетности - полное исключение вашего участия в аналитическом процессе. Вы вводите данные бухгалтерской отчетности (российской, МСФО или US GAAP) и получаете по результатам анализа отчет.	(http://www.audit-it.ru/finanaliz/start/)
3	СПАРК. Качественная информация о предприятиях объединена с мощными аналитическими инструментами. Созданы сервисы, базирующиеся на достоверных источниках информации и глубоком понимании задач. Все вышеперечисленное позволяет мгновенно оценить платежеспособность и надежность предприятий.	http://www.spark-interfax.ru/promo/

7. Материально-техническое и программное обеспечение дисциплины

7.1. Помещения для ведения образовательного процесса и оборудование

Наименование помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом, в том числе помещения для самостоятельной работы, с указанием перечня основного оборудования, учебно-наглядных пособий и используемого программного обеспечения	Адрес (местоположение) помещений для проведения всех видов учебной деятельности, предусмотренной учебным планом
Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа: комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование, учебно-наглядные пособия в виде презентаций, программное обеспечение: MS Windows, MS Office	394087, Воронежская область, г. Воронеж, ул. Мичурина, д.1

Учебная аудитория для проведения лабораторных и практических занятий, текущего контроля и промежуточной аттестации: комплект учебной мебели, демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в электронном виде, компьютеры с возможностью подключения к Интернет и доступом в ЭИОС; программное обеспечение: MS Windows, MS Office, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, ALT Linux, LibreOffice, AST Test, Statistica	394087, Воронежская область, г. Воронеж, ул. Мичурина, д.1
Учебная аудитория для проведения лабораторных и практических занятий, индивидуальных и групповых консультаций: комплект учебной мебели, компьютеры с возможностью подключения к "Интернет" и обеспечением доступа в ЭИОС; программное обеспечение: MS Windows, MS Office, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, ALT Linux, LibreOffice, AST Test, Statistica	394087, Воронежская область, г. Воронеж, ул. Мичурина, д.1
Помещение для хранения и профилактического обслуживания учебного оборудования: мебель для хранения и обслуживания учебного оборудования, специализированное оборудование для ремонта компьютеров	394087, Воронежская область, г. Воронеж, ул. Мичурина, д.1, а.: 117, 118
Помещение для самостоятельной работы: комплект учебной мебели, компьютеры с возможностью подключения к "Интернет" и обеспечением доступа в ЭИОС; программное обеспечение: MS Windows, MS Office, DrWeb ES, 7-Zip, MediaPlayer Classic, Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Internet Explorer, ALT Linux, LibreOffice, AST Test	394087, Воронежская область, г. Воронеж, ул. Мичурина, д.1, а.: 113, 115, 116, 119, 120, 122, 122а, 126, 219 (с 16.00 до 20.00)

7.2. Программное обеспечение

7.2.1. Программное обеспечение общего назначения

№	Название	Размещение
1	Операционные системы MS Windows /Linux /Ред ОС	ПК в локальной сети ВГАУ
2	Пакеты офисных приложений MS Office / OpenOffice/LibreOffice	ПК в локальной сети ВГАУ
3	Программы для просмотра файлов Adobe Reader / DjVu Reader	ПК в локальной сети ВГАУ
4	Браузеры Яндекс Браузер / Mozilla Firefox / Microsoft Edge	ПК в локальной сети ВГАУ
5	Антивирусная программа DrWeb ES	ПК в локальной сети ВГАУ
6	Программа-архиватор 7-Zip	ПК в локальной сети ВГАУ
7	Мультимедиа проигрыватель MediaPlayer Classic	ПК в локальной сети ВГАУ
8	Платформа онлайн-обучения eLearning server	ПК в локальной сети ВГАУ
9	Система компьютерного тестирования AST Test	ПК в локальной сети ВГАУ

7.2.2. Специализированное программное обеспечение

№	Название	Размещение
1	Пакет статистической обработки данных Statistica	ПК в локальной сети ВГАУ

8. Междисциплинарные связи

Наименование дисциплины, с которой проводилось согласование	Кафедра, с которой проводилось согласование	Подпись заведующего кафедрой
Микроэкономика ПУ	Экономической теории и мировой экономики	

**Лист периодических проверок рабочей программы
и информация о внесенных изменениях**

Должностное лицо, проводившее проверку: Ф.И.О., должность	Дата	Потребность в корректировке указанием соответствующих разделов рабочей программы	Информация о внесенных изменениях
и.о. заведующего кафедрой, проф. Л.А. Запорожцева	Протокол № 12 от 20.06.2022 г.	Есть 3. Объем дисциплины и виды работ, 3.1 Очная форма обучения, 3.2. Очно- заочная форма обучения	В связи с изменением учебного плана на 2022- 2023 г. скорректированы объем часов и виды работ
и.о. заведующего кафедрой, проф. Л.А. Запорожцева	Протокол № 12 от 20.06.2022 г.	Есть 4.2. Распределение контактной и самостоятельной работы при подготовке к занятиям по подразделам 4.2.1. Очная форма обучения, 4.2.2. Очно- заочная форма обучения	В связи с изменением учебного плана на 2022- 2023 г. скорректированы объем часов контактной работы (лекции и практические занятия) и самостоятельной работы
и.о. заведующего кафедрой, проф. Л.А. Запорожцева	Протокол № 12 от 20.06.2022 г.	Есть 4.3. Перечень тем и учебно- методического обеспечения для самостоятельной работы обучающихся	В связи с изменением учебного плана на 2022- 2023 г. скорректирован объем часов самостоятельной работы
и.о. заведующего кафедрой, проф. Л.А. Запорожцева	Протокол № 12 от 20.06.2022 г.	Есть 7. Материально- техническое и программное обеспечение дисциплины, п. 7.1. Помещения для ведения образовательного процесса и оборудование, 7.1.1. Для контактной работы, 7.1.2. Для самостоятельной работы	Заменено «GoogleChrome» на «Яндекс Браузер»
и.о. заведующего кафедрой, проф. Л.А. Запорожцева	Протокол № 12 от 20.06.2022 г.	Есть 7.2.1 Программное обеспечение общего назначения	Внесены уточнения по программному обеспечению
и.о. заведующего кафедрой, проф. Л.А. Запорожцева	Протокол № 12 от 20.06.2022 г.	Рабочая программа актуализирована на 2022- 2023 учебный год	
Зав. кафедрой Запорожцева Л.А.	Протокол № 11 от 19.06.2023 г	Рабочая программа актуализирована на 2023- 2024 учебный год	