

МИНОБРНАУКИ РОССИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ВОРОНЕЖСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
(ФГБОУ ВО ВГУ)

УТВЕРЖДАЮ

Заведующий кафедрой
Информационных технологий
и математических методов в экономике



И.Н. Щепина

18.05.2022г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЫ
Б1.О.14 ЭКОНОМЕТРИКА

1. Код и наименование направления подготовки/специальности:

38.03.02 Менеджмент

2. Профиль подготовки / специализация:

Управление бизнесом

3. Квалификация выпускника: Бакалавр

4. Форма обучения: очная

5. Кафедра, отвечающая за реализацию дисциплины:

Кафедра информационных технологий и математических методов в экономике

6. Составители программы: Мокшина Светлана Ивановна, к.э.н., доцент
кафедры информационных технологий и математических методов в экономике

7. Рекомендована:

НМС экономического ф-та ВГУ, протокол № 4 от 21.04.2022 г.

8. Учебный год: 2023 - 2024, семестр: 4

9. Цели и задачи учебной дисциплины:

Целями освоения учебной дисциплины являются:

- формирование у обучающихся представления о теоретических основах эконометрики, основных эконометрических моделях и методах анализа данных;
- приобретение обучающимися практических умений и навыков количественного анализа взаимосвязей экономических процессов и явлений и их применение для обоснования принятия управленческих решений в бизнесе

Задачи учебной дисциплины:

- изучение основ эконометрического моделирования и базовых моделей эконометрики;
- использование современных информационных технологий и специализированного программного обеспечения для проведения первичной статистической обработки данных и расчетов с использованием эконометрических моделей;
- углубление знаний по теории количественных экономических измерений; изучение пространственных и временных эконометрических моделей, описывающих поведение экономических агентов;
- освоение методики проверки согласованности гипотез, сформированных на базе теоретических моделей, с результатами эмпирических исследований;
- применение эконометрических методов оценивания при работе с реальными статистическими данными.

10. Место учебной дисциплины в структуре ООП:

Блок Б1, обязательная часть

Требования к входным знаниям, умениям и навыкам:

обучающийся должен иметь базовые знания по дисциплинам:

- математика;
- экономическая теория;

обучающийся должен уметь:

- работать с данными официальной статистики;
- проводить качественный анализ данных статистики;
- осуществлять качественный анализ связей экономических показателей

обучающийся должен иметь навыки:

- работы в MS Excel;
- визуализации и содержательной интерпретации полученных результатов

Знания, полученные при изучении данной дисциплины, могут быть использованы в дисциплинах профессионального цикла.

11. Планируемые результаты обучения по дисциплине /модулю (знания, умения, навыки), соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы (компетенциями) и индикаторами их достижения:

| Код | Название компетенции | Код(ы) | Индикатор(ы) | Планируемые результаты обучения |
|-------|--|---------|--|---|
| ОПК-5 | Способен использовать при решении профессиональных задач современные информационные технологии и программные средства, включая управление крупными | ОПК-5.1 | Использует готовые проекты и пакеты прикладных программ для решения профессиональных задач | <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - современные методы эконометрического анализа; - основные этапы проведения эконометрического исследования. <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - формулировать задачу исследования на предметно – содержательном уровне; - строить эконометрические модели, позволяющие адекватно отражать реальные процессы и явления. <p>Владеть:</p> |

| | | | | |
|-------|---|---------|---|--|
| | массивами данных и их интеллектуальный анализ | | | <ul style="list-style-type: none"> - навыками работы в основных статистических пакетах в целях построения эконометрических моделей; - навыками содержательной интерпретации результатов моделирования и выработки практических рекомендаций на основе полученных результатов. |
| | | ОПК-5.2 | <p>Применяет современные информационно-коммуникационные технологии с учетом основных требований информационной безопасности</p> | <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - технологии моделирования количественных взаимосвязей в экономических процессах и явлениях; - основные принципы работы с аналитическими информационными системами. <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - осуществлять выбор инструментальных средств для обработки статистических данных в соответствии с поставленной задачей. <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - навыками использования современных информационных технологий и специализированных ПО для решения эконометрических задач; |
| ОПК-6 | Способен понимать принципы работы современных информационных технологий и использовать их для решения задач профессиональной деятельности | ОПК-6.1 | <p>Осуществляет поиск, сбор, хранение, обработку, представление информации при решении задач профессиональной деятельности</p> | <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - сущность и значение статистической информации в развитии современного информационного общества; - основные методы сбора и систематизации информации для расчета социально-экономических показателей <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> -проводить качественный анализ статистической информации; -применять процедуры восстановления пропусков в данных <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> -методикой расчета социально-экономических показателей; -навыками применения количественных методов анализа социально-экономических явлений и процессов |
| | | ОПК-6.2 | <p>Подбирает и использует информационные технологии при решении задач профессиональной деятельности</p> | <p>Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - технологии моделирования бизнес-процессов; - основные принципы работы с аналитическими информационными системами <p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - осуществлять выбор инструментальных средств для обработки статистических данных в соответствии с поставленной задачей <p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - навыками применения |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | информационных технологий в процедурах бизнес-анализа |
|--|--|--|--|---|

12. Объем дисциплины в зачетных единицах/часах в соответствии с учебным планом - 3/108.

Форма промежуточной аттестации – зачет

13. Трудоемкость по видам учебной работы

| Вид учебной работы | Трудоемкость | | | |
|--|--------------|--------------|----|-----|
| | Всего | По семестрам | | |
| | | Семестр 4 | | ... |
| Аудиторные занятия | 50 | 50 | | |
| в том числе: | лекции | 16 | 16 | |
| | практические | | | |
| | лабораторные | 34 | 34 | |
| Самостоятельная работа | 58 | 58 | | |
| в том числе: курсовая работа (проект) | - | - | | |
| Форма промежуточной аттестации - зачет | | | | |
| Итого: | 108 | 108 | | |

13.1. Содержание дисциплины

| п/п | Наименование раздела дисциплины | Содержание раздела дисциплины | Реализация раздела дисциплины с помощью онлайн-курса, ЭУМК * |
|------------------|---|--|---|
| 1. Лекции | | | |
| 1.1 | Предмет и задачи эконометрики | Понятие эконометрики. Этапы эконометрического исследования. Основные виды эконометрических моделей. Измерения в экономике. Специфика экономических измерений. Классификация задач, решаемых с помощью эконометрики. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 1.2 | Парная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях | Спецификация модели. Линейная регрессия и корреляция. Методы оценивания параметров уравнения регрессии. Классический метод наименьших квадратов (МНК). Состоятельность, несмещенность и эффективность МНК – оценок. Определение качества модели регрессии. Оценка значимости параметров линейной регрессии и корреляции. Точечный и интервальный прогноз на основе линейного уравнения регрессии. Нелинейная регрессия. Подбор линеаризующего преобразования. Корреляция для нелинейной регрессии. Содержательная интерпретация параметров степенной и показательной формы нелинейной регрессии. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 1.3 | Множественная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях | Спецификация модели. Отбор факторов для построения множественной регрессии. Классический МНК для модели множественной регрессии. Множественная корреляция. Частная корреляция. Множественная регрессия в стандартизованном масштабе. Оценка надежности результатов множественной | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |

| | | | |
|---|--|--|---|
| | | регрессии и корреляции: F - критерий Фишера; t – критерий Стьюдента. Нелинейные регрессионные модели. Показатели корреляции и детерминации для нелинейной регрессии. Фиктивные переменные во множественной регрессии. | |
| 1.4 | Множественная регрессия в условиях мультиколлинеарности факторов | Причины возникновения и последствия мультиколлинеарности факторов. Оценка мультиколлинеарности факторов. Устранение мультиколлинеарности: исключение из модели одного или нескольких факторов; преобразование факторов; метод главных компонент, гребневая регрессия или ридж – оценивание. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 1.5 | Обобщенная схема регрессионного анализа | Предпосылки метода наименьших квадратов. Гомо – и гетероскедастичность остатков регрессионной модели. Обнаружение гетероскедастичности: тесты Уайта, Бреуша – Пагана, Гольдфельда – Квандта. Обобщенная схема метода наименьших квадратов. Теорема Айткена. Взвешенный метод наименьших квадратов для построения регрессии в условиях гетероскедастичности. Автокорреляция остатков регрессионной модели. Критерий Дарбина – Уотсона. Оценка параметров регрессионной модели доступным МНК в условиях автокорреляции остатков. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 1.6 | Моделирование временных рядов | Понятие временного ряда; основные компоненты временного ряда. Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры. Моделирование тенденции временного ряда. Адекватность трендовой модели: критерий Дарбина-Уотсона. Моделирование сезонных и циклических колебаний. Аддитивная и мультипликативная модели временного ряда. Применение фиктивных переменных для моделирования сезонных колебаний. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 1.7 | Динамические эконометрические модели | Общая характеристика моделей с распределенным лагом и моделей авторегрессии. Изучение структуры лага и выбор вида модели с распределенным лагом: лаги Алмон, метод Койка. Модели адаптивных ожиданий и неполной корректировки. Оценка параметров моделей авторегрессии методом инструментальных переменных. Интерпретация параметров моделей с распределенным лагом и моделей авторегрессии | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 2. Практические занятия не предусмотрены | | | |
| 3. Лабораторные занятия | | | |
| 3.1 | Предмет и задачи эконометрики | Сбор данных официальной статистики; проведение качественного анализа полученной информации. Освоение методик восстановления данных при наличии пропусков в статистической информации. Расчет описательной статистики. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 3.2 | Парная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях | Построение модели линейной однофакторной регрессии. Оценка параметров модели МНК. Расчет коэффициента корреляции, коэффициента детерминации. Оценка значимости уравнения регрессии в целом с помощью F-критерия Фишера. Оценка значимости параметров регрессии. Построение точечного и интервального прогноза на основе уравнения регрессии. Построение различных | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |

| | | | |
|-----|--|---|---|
| | | видов нелинейной регрессии; вычисление индекса корреляции для оценки тесноты связи показателя y и фактора x . | |
| 3.3 | Множественная регрессия и корреляция | Построение модели множественной линейной регрессии. Оценка параметров модели с применением матричного МНК. Оценка надежности результатов множественной регрессии. Построение нелинейных регрессионных моделей различных видов. Использование фиктивных переменных в модели множественной регрессии. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 3.4 | Множественная регрессия в условиях мультиколлинеарности факторов | Построение множественной регрессии в условиях мультиколлинеарности факторов. Выявление эффекта мультиколлинеарности и его устранение различными способами; исключение из модели одного или нескольких факторов; преобразование факторов; метод главных компонент, использование гребневой регрессии (процедуры ридж – оценивания). | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 3.5 | Обобщенная схема регрессионного анализа | Построение множественной регрессии в условиях гетероскедастичности остатков регрессионной модели: применение тестов Уайта, Бреуша-Пагана, Гольдфельда-Квандта для проверки гипотезы на гетероскедастичность; использование взвешенного МНК для оценки параметров регрессии в условиях гетероскедастичности остатков. Выявление автокорреляции в остатках с помощью критерия Дарбина-Уотсона. Построение модели регрессии доступным обобщенным МНК в условиях автокорреляции в остатках. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 3.6 | Моделирование временных рядов | Построение трендовых моделей: анализ абсолютных приростов и их производных характеристик; выбор аналитической функции тренда; оценка параметров модели МНК; проверка адекватности трендовой модели. Моделирование сезонных и циклических колебаний: построение аддитивной и мультипликативной моделей временного ряда. Применение фиктивных переменных для моделирования сезонных колебаний. | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |
| 3.7 | Динамические эконометрические модели | Построение регрессионных моделей с лаговыми переменными. Выбор вида модели с распределенным лагом: лаги Алмон, метод Койка. Построение моделей авторегрессии. Оценка параметров моделей авторегрессии методом инструментальных переменных. Интерпретация параметров моделей с распределенным лагом и моделей авторегрессии | Эконометрика https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |

13.2. Темы (разделы) дисциплины и виды занятий

| № п/п | Наименование темы (раздела) дисциплины | Виды занятий (количество часов) | | | | Всего |
|-------|--|---------------------------------|--------------|--------------|------------------------|-------|
| | | Лекции | Практические | Лабораторные | Самостоятельная работа | |
| 1 | Предмет и задачи эконометрики | 2 | | 2 | 4 | 8 |
| 2 | Парная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях | 2 | | 4 | 8 | 14 |

| | | | | | | |
|---|--|----|--|----|----|-----|
| 3 | Множественная регрессия и корреляция | 4 | | 6 | 10 | 20 |
| 4 | Множественная регрессия в условиях мультиколлинеарности и факторов | 2 | | 4 | 8 | 14 |
| 5 | Обобщенная схема регрессионного анализа | 2 | | 6 | 10 | 18 |
| 6 | Моделирование временных рядов | 2 | | 6 | 10 | 18 |
| 7 | Динамические эконометрические модели | 2 | | 6 | 8 | 16 |
| | зачет | | | | | |
| | Итого | 16 | | 34 | 58 | 108 |

14. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины:

В процессе изучения дисциплины используются такие виды учебной работы, как лекции, лабораторные занятия, а также различные виды самостоятельной работы.

Обучающимся рекомендуется вести конспект лекции, в котором должны быть ссылки на номера слайдов и демонстрационные примеры, основные определения и положения необходимо конспектировать, в конце лекции обучающиеся имеют возможность задать вопросы преподавателю по теме лекции. Конспект должен иметь поля для заметок в ходе самостоятельной проработки материала. Презентации лекций и демонстрационный материал в виде файлов предоставляются обучающимся.

Для подготовки к лабораторному занятию обучающийся должен заранее ознакомиться с заданием и теоретическим материалом, после выполнения работы оформить отчет о проделанной работе.

Самостоятельная работа обучающихся направлена на самостоятельное изучение отдельных тем и некоторых вопросов учебной дисциплины. Самостоятельная работа является обязательной для каждого обучающегося, ее объем определяется учебным планом. Обучающийся работает с рекомендованными материалами при минимальном участии преподавателя.

Самостоятельная работа с учебниками, учебными пособиями, научной, справочной литературой, ресурсами сети Internet, статистическими данными является наиболее эффективным методом получения знаний, позволяет значительно активизировать процесс овладения информацией, способствует более глубокому усвоению изучаемого материала, формирует у обучающихся свое отношение к конкретной проблеме.

Вопросы, которые вызывают у обучающихся затруднения при подготовке, должны быть заранее сформулированы и озвучены во время занятий в аудитории для дополнительного разъяснения преподавателем.

Виды самостоятельной работы: конспектирование учебной и научной литературы; проработка учебного материала (по конспектам лекций, учебной и научной литературе); работа в электронной библиотечной системе; выполнение домашних заданий; выполнение контрольных работ; подготовка к практическим занятиям; работа с вопросами для самопроверки.

15.Перечень основной и дополнительной литературы, ресурсов интернет, необходимых для освоения дисциплины

а) основная литература:

| № п/п | Источник |
|-------|---|
| 1 | Буре В.М. Теория вероятностей и математическая статистика / В.М. Буре, Е.М. Парилина. - М. : Лань, 2013. -416 с. // Издательство «Лань» : электронно-библиотечная система. - URL : lanbook.lib.vsu.ru. |
| 2 | Горлач Б.А. Теория вероятностей и математическая статистика / Б.А. Горлач. - М.: Лань, 2013. - 320 с. // Издательство «Лань» : электронно-библиотечная система. - URL : lanbook.lib.vsu.ru. |
| 3 | Эконометрика: учебник для студентов вузов, обучающихся по специальности 061700 "Статистика" / И.И. Елисеева [и др.] ; под ред. И.И. Елисеевой .— 2-е изд., перераб. и доп. — М. : Финансы и статистика, 2008 .— 574, [1] с. : ил., табл. — Библиогр.: с. 556-557 .— Предм. указ.: с. 571-575 .— ISBN 978-5-279-02786-6. |
| 4 | Кремер Н.Ш.. Эконометрика: учебник для студентов вузов, обучающихся по специальностям экономики и управления / Н.Ш. Кремер, Б.А. Путко ; под ред. Н.Ш. Кремера .— 2-е изд., стер. — М. : ЮНИТИ, 2008 .— 310, [1] с. : ил., табл. — Библиогр.: с. 289-290 .— Предм. указ.: с. 299-306 .— ISBN 978-5-238-01286-5 |

б) дополнительная литература:

| № п/п | Источник |
|-------|--|
| 5 | Боровков А. А. Математическая статистика / А.А. Боровков. - М.: Лань, 2010. - 704 с. // Издательство «Лань» : электронно-библиотечная система. - URL : lanbook.lib.vsu.ru. |
| 6 | Практикум по эконометрике : Учебное пособие для экономических вузов / И.И. Елисеева, С.В. Курышева, Н.М. Гордеенко и др. ; Под ред. И.И. Елисеевой .— М. : Финансы и статистика, 2004 .— 189,[2] с. : ил., табл. — ISBN 5-279-02313-2. |
| 7 | Давнис В.В. Эконометрические методы прогнозирования: учебное пособие для слушателей магистерских программ / В.В. Давнис, В.И. Тинякова. - Воронеж: ЦНТИ, 2009.-235 с.- ISBN 978-5-4218-0001-9 |
| 8 | Тинякова В.И.. Эконометрика: задачи и компьютерные решения : учебное пособие / В.И. Тинякова ; Воронеж. гос. ун-т, Лиск. фил. — Воронеж : Воронеж. гос. ун-т, 2006 .— 93 с. : ил., табл. — Библиогр.: с. 88 .— ISBN 5-9273-09556-9 .— <URL: http://www.lib.vsu.ru/elib/texts/method/vsu/sep06032.pdf >. |
| 9 | Давнис В.В. Основы эконометрического моделирования: Учебное пособие для студ., обучающихся по специальностям: "Финансы и кредит", "Бух. учет, анализ и аудит", "Мировая экономика" / В.В. Давнис, В.И. Тинякова .— Воронеж : АОНО "ИММИФ", 2003 .— 155 с. : ил., табл. — Библиогр.: с. 154-155.- ISBN 5-901932-2-X |

в) информационные электронно-образовательные ресурсы (официальные ресурсы интернет):

| № п/п | Ресурс |
|-------|---|
| 1 | Зональная научная библиотека ВГУ https://www.lib.vsu.ru/ |
| 2 | ЭБС Лань, http://e.lanbook.com/ |
| 3 | ЭБС Университетская библиотека online https://biblioclub.ru/ |
| 4 | Национальный цифровой ресурс «РУКОНТ» http://rucont.ru |
| 5 | Портал «Электронный университет ВГУ» – Moodle: URL: https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332 |

| | |
|---|--|
| 6 | Российская государственная библиотека. Единый электронный каталог http://www.rsl.ru/ru/s97/s977242/ |
|---|--|

16. Перечень учебно-методического обеспечения для самостоятельной работы

| № п/п | Источник |
|-------|---|
| 1 | Мхитарян В.С.. Прикладная статистика. Основы эконометрики : учебник для студентов экономических специальностей : в 2 т. / В.С. Мхитарян, С.А. Айвазян .— 2-е изд., испр. — М. : ЮНИТИ, 2001 |

17. Образовательные технологии, используемые при реализации учебной дисциплины, включая дистанционные образовательные технологии (ДОТ, электронное обучение (ЭО), смешанное обучение):

Каждый обучающийся обеспечен индивидуальным неограниченным доступом к электронно-библиотечным системам (электронным библиотекам) и к электронной информационно-образовательной среде. Электронно-библиотечная система (электронная библиотека) и электронная информационно-образовательная среда обеспечивают возможность доступа обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет», как на территории ФГБОУ ВО «ВГУ», так и вне ее.

Для организации занятий требуется:

- персональный компьютер и видеопроекторное оборудование;
- программное обеспечение общего назначения Microsoft Office;

Программа курса может реализовываться с элементами электронного обучения и применением дистанционных образовательных технологий через Образовательный портал «Электронный университет ВГУ» <https://edu.vsu.ru/course/view.php?id=10332>, где представлены учебные материалы, а также предоставляется возможность в режиме онлайн проводить занятия в соответствии с расписанием.

Информационно-справочные ресурсы

1. <http://www.ict.edu.ru> - портал "Информационно-коммуникационные технологии в образовании" .
2. <http://www.iot.ru> - портал Информационных образовательных технологий.
3. <http://biznit.ru> - сайт о применении информационных технологий в различных областях.
4. <http://www.hse.ru> - Портал Высшей Школы Экономики;
5. <http://ecsocman.edu.ru> - Федеральный образовательный портал «Экономика. Социология. Менеджмент»;
6. <http://www.aup.ru> - Портал по менеджменту, маркетингу и рекламе, финансам, инвестициям, управлению персоналом;
7. <http://www.eu.ru> - Экономика и управление на предприятиях. Научно-образовательный портал. Библиотека экономической и управленческой литературы;
8. Российская государственная библиотека. Единый электронный каталог <http://www.rsl.ru/ru/s97/s977242/>
9. Научная электронная библиотека <http://elibrary.ru>
10. Российская национальная библиотека <http://www.nlr.ru>

18. Материально-техническое обеспечение дисциплины:

Учебный корпус бизнес-школы ВГУ имеет требуемое количество лекционных аудиторий, оснащенных необходимым оборудованием, компьютерные классы, имеющие необходимый комплект лицензионного программного обеспечения.

Учебная аудитория (лекционная): специализированная мебель, ноутбук HP Probook 450 15.6", проектор Acer X1240, экран для проектора настенный Projecta Compact Electrol, WHDMI-приемник

Учебная аудитория (для лабораторных занятий): специализированная мебель, компьютеры 3QNTP-Shell NM-10-B260GBP-525 (11 шт.)

Библиотечный фонд библиотеки бизнес-школы, а также библиотеки экономического факультета ВГУ имеет в наличии достаточное количество учебной и учебно-методической литературы, перечисленной в настоящей рабочей программе. Студенты имеют доступ к учебной литературе, представленной в ЭБС.

19. Оценочные средства для проведения текущей и промежуточной аттестаций

Порядок оценки освоения обучающимися учебного материала определяется содержанием следующих разделов дисциплины:

| № п/п | Наименование раздела дисциплины (модуля) | Компетенция(и) | Индикатор(ы) достижения компетенции | Оценочные средства |
|--|--|----------------|-------------------------------------|--|
| 1. | Предмет и задачи эконометрики | ОПК-5 | ОПК-5.1 | Отчет о выполнении лабораторного задания |
| 2. | Парная регрессия и корреляция в эконометрических исследованиях | ОПК-5 | ОПК-5.1 ОПК-5.2 | Отчет о выполнении лабораторного задания Тест 1 |
| 3 | Множественная регрессия и корреляция | ОПК-5 | ОПК-5.1 ОПК-5.2 | Отчет о выполнении лабораторного задания Тест 2 |
| 4 | Множественная регрессия в условиях мультиколлинеарности факторов | ОПК-5 | ОПК-5.1 ОПК-5.2 | Отчет о выполнении лабораторного задания |
| 5 | Обобщенная схема регрессионного анализа | ОПК-6 | ОПК-6.1 ОПК-6.2 | Отчет о выполнении лабораторного задания |
| 6 | Моделирование временных рядов | ОПК-6 | ОПК-6.1 ОПК-6.2 | Отчет о выполнении лабораторного задания |
| 7 | Динамические эконометрические модели | ОПК-6 | ОПК-6.1 ОПК-6.2 | Отчет о выполнении лабораторного задания |
| Промежуточная аттестация форма контроля - зачет | | | | Итоговый тест |

20 Типовые оценочные средства и методические материалы, определяющие процедуры оценивания

20.1 Текущий контроль успеваемости

Контроль успеваемости по дисциплине осуществляется с помощью следующих оценочных средств: отчетов о выполнении лабораторных заданий, тестов для проверки теоретических знаний.

**Лабораторный практикум по теме
«Парная регрессия и корреляция»**

Задание 1. Начальник отдела маркетинга кинотеатра «Отражение» поручил своим сотрудникам провести исследование, в результате которого необходимо:

1) выявить фактор, в наибольшей степени влияющий на среднее число зрителей за первые три дня проката фильма;

2) построить прогнозную модель в виде линейной функции;

3) с помощью построенной модели получить прогнозные оценки среднего числа зрителей на первые три дня проката следующих двух фильмов.

Специалисты отдела маркетинга экспертным путем в качестве фактора, в наибольшей степени влияющего на посещение киносеансов, установили расходы на рекламу фильма, (см. табл.1). Выполните 2-е и 3-е задание начальника отдела маркетинга.

Таблица 1

| Среднее число зрителей за первые три дня проката фильма | Расходы на рекламу фильма, руб. | Среднее число зрителей за первые три дня проката фильма | Расходы на рекламу фильма, руб. |
|---|---------------------------------|---|---------------------------------|
| 282 | 2750 | 305 | 4565 |
| 263 | 2430 | 328 | 5987 |
| 295 | 3700 | 335 | 6100 |
| 276 | 2860 | 251 | 2375 |
| 285 | 3180 | 292 | 3480 |
| 342 | 4270 | 290 | 3295 |
| 276 | 2875 | 387 | 7500 |
| 328 | 5295 | 326 | 5430 |
| 321 | 5140 | 347 | 6310 |
| 326 | 4870 | 234 | 2100 |

Задание 2. В табл. 2 представлены данные, которые были собраны при проведении исследований по оценке стоимости недвижимости.

Таблица 2

| Дом | Оценка инвентаризации, тыс. у.е. | Рыночная стоимость, тыс. у.е. | Дом | Оценка инвентаризации, тыс. у.е. | Рыночная стоимость, тыс. у.е. |
|-----|----------------------------------|-------------------------------|-----|----------------------------------|-------------------------------|
| 1 | 68,2 | 87,4 | 16 | 74,0 | 88,4 |
| 2 | 74,6 | 88,0 | 17 | 72,8 | 93,6 |
| 3 | 64,6 | 87,2 | 18 | 80,4 | 92,8 |
| 4 | 80,2 | 94,0 | 19 | 74,2 | 90,6 |
| 5 | 76,0 | 94,2 | 20 | 80,0 | 91,6 |
| 6 | 78,0 | 93,6 | 21 | 81,6 | 92,8 |
| 7 | 76,0 | 88,4 | 22 | 75,6 | 89,0 |
| 8 | 77,0 | 92,2 | 23 | 79,4 | 91,8 |
| 9 | 75,2 | 90,4 | 24 | 82,2 | 98,4 |
| 10 | 72,4 | 90,4 | 25 | 67,0 | 89,8 |
| 11 | 80,0 | 93,6 | 26 | 72,0 | 97,2 |
| 12 | 76,4 | 91,4 | 27 | 73,6 | 95,2 |
| 13 | 70,2 | 89,6 | 28 | 71,4 | 88,8 |
| 14 | 75,8 | 91,8 | 29 | 81,0 | 97,4 |
| 15 | 79,2 | 94,8 | 30 | 80,6 | 95,4 |

Построить регрессионное уравнение, отражающее зависимость рыночной стоимости дома от стоимости, указанной в книге инвентаризации.

Для построенного уравнения вычислить:

1) коэффициент корреляции; 2) коэффициент детерминации; 3) дисперсионное отношение Фишера; 3) стандартные ошибки коэффициентов регрессии; 4) *t*-статистики Стьюдента; 5) доверительные границы коэффициентов регрессии; 6) усредненное значение коэффициента эластичности.

Рассчитайте рыночную стоимость дома, если инвентаризационная комиссия оценит его в 90,5 тыс. у.е.

Все расчеты проведите в Excel с использованием формул регрессионного и корреляционного анализов и пакета Анализа. Результаты, полученные по формулам и с помощью пакета Анализа, сравните между собой.

Задание 3. По данным табл. 2 постройте уравнения регрессии в виде показательной и степенной функции. Для построенного уравнения вычислите:

1) индекс корреляции; 2) коэффициент детерминации; 3) *F*-критерий.

Дайте содержательную интерпретацию коэффициента регрессии, построенных моделей. Все расчеты проведите в Excel с использованием выше приведенных формул.

Лабораторный практикум по теме «Множественная регрессия и корреляция»

Задание 4. 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 табл. 4. Прогнозные оценки факторов, влияющие на прибыль компании, необходимо получить с помощью трендовых моделей.

Таблица 4

| Квар-тал | Прибыль компании, тыс. руб. | Общее число абонентов компании | Выручка за мобильный трафик, тыс. руб. | Затраты на поддержание и обновление программного 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 |

Задание 5. Экономисту-аналитику одной крупной компании было поручено указать обоснованный размер заработной платы руководителя будущего филиала этой компании. Ожидаемый объем среднемесячных продаж филиала составит 6500 тыс. у.е. Возраст сотрудника, который, как планируется, должен занять пост руководителя, – 45 лет, он имеет законченное высшее образование, а срок работы в должности директора другого филиала компании – 3 года. Для решения поставленной задачи экономист-аналитик сначала изучил опыт других компаний, собрав сведения, представленные в таблице 5, где y – среднемесячная заработная плата руководителей, у.е.; x_1 – возраст, лет; x_2 – образование (0 – нет высшего образование, 1 – незаконченное высшее, 2 – высшее); x_3 – срок работы в должности руководителя, лет; x_4 – годовой объем продаж компании, тыс. у.е.

Таблица 5

| Компания | y | x_1 | x_2 | x_3 | x_4 | Компания | y | x_1 | x_2 | x_3 | x_4 |
|----------|-------|-------|-------|-------|--------|----------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 1 | 453 | 43 | 0 | 26 | 872 | 16 | 1 652 | 60 | 2 | 14 | 12 949 |
| 2 | 1 948 | 55 | 2 | 23 | 1 227 | 17 | 782 | 49 | 1 | 9 | 5 061 |
| 3 | 1 735 | 57 | 2 | 15 | 1 712 | 18 | 613 | 46 | 1 | 1 | 1 929 |
| 4 | 643 | 65 | 1 | 23 | 1 681 | 19 | 1 488 | 58 | 2 | 8 | 2 643 |
| 5 | 1 461 | 63 | 2 | 8 | 5 673 | 20 | 447 | 50 | 2 | 1 | 1 084 |
| 6 | 357 | 54 | 0 | 1 | 1 117 | 21 | 1 752 | 63 | 1 | 14 | 5 137 |
| 7 | 669 | 51 | 1 | 2 | 1 475 | 22 | 2 497 | 64 | 0 | 30 | 844 |
| 8 | 2 094 | 63 | 2 | 8 | 10 818 | 23 | 768 | 60 | 1 | 8 | 2 097 |
| 9 | 597 | 57 | 0 | 23 | 2 686 | 24 | 2 342 | 71 | 2 | 34 | 835 |
| 10 | 889 | 56 | 1 | 5 | 220 | 25 | 3 409 | 73 | 1 | 30 | 14 021 |
| 11 | 514 | 47 | 0 | 3 | 661 | 26 | 2 244 | 64 | 2 | 5 | 4 451 |
| 12 | 466 | 48 | 1 | 2 | 1 539 | 27 | 601 | 59 | 2 | 5 | 1 911 |
| 13 | 2 833 | 50 | 2 | 14 | 11 663 | 28 | 1 554 | 61 | 1 | 17 | 1 435 |
| 14 | 427 | 54 | 1 | 15 | 2 366 | 29 | 462 | 57 | 0 | 11 | 1 314 |
| 15 | 1 856 | 62 | 2 | 3 | 4 864 | 30 | 587 | 55 | 0 | 5 | 2 301 |

Постройте модель множественной регрессии, отражающую зависимость среднемесячной зарплаты от указанных факторов, и оцените ее качество. Используя построенную модель, осуществите расчет заработной платы руководителя будущего филиала компании.

Задание 6. Торговое предприятие «Альянс» имеет сеть, состоящую из 12 магазинов, информация о деятельности которых представлена в табл. 6. Постройте:

- 1) линейное двухфакторное регрессионное уравнение, отражающее зависимость переменной y от соответствующих факторов x_1 и x_2 ;
- 2) нелинейные модели, отражающие показательную и степенную зависимости переменной y от соответствующих факторов x_1 и x_2 .

Оцените качество построенных моделей и выберите лучшую из них по коэффициенту средней абсолютной ошибки аппроксимации

Таблица 6

| № магазина | Годовой товарооборот, млн. руб. | Торговая площадь, тыс. кв.м. | Среднее число посетителей в день, тыс. чел. |
|------------|---------------------------------|------------------------------|---|
| 1 | 19,76 | 0,24 | 8,25 |
| 2 | 38,09 | 0,31 | 10,24 |
| 3 | 40,95 | 0,55 | 9,31 |
| 4 | 41,08 | 0,48 | 11,01 |
| 5 | 56,29 | 0,78 | 8,54 |
| 6 | 68,51 | 0,98 | 7,51 |

| | | | |
|----|--------|------|-------|
| 7 | 75,01 | 0,94 | 12,36 |
| 8 | 89,05 | 1,21 | 10,81 |
| 9 | 91,13 | 1,29 | 9,89 |
| 10 | 91,26 | 1,12 | 13,72 |
| 11 | 99,84 | 1,29 | 12,27 |
| 12 | 108,55 | 1,49 | 13,92 |

Лабораторный практикум по теме
«Множественная регрессия в условиях
мультиколлинеарности факторов»

Задание 7. Владельцы интернет-аукциона «Э-Слава» составляют бизнес-план своей деятельности на следующие два месяца. Их прежде всего интересует вопрос, каким образом можно увеличить объем реализации в натуральном выражении. В ходе исследования было выявлено, что на количество совершаемых в среднем за месяц покупок (y) влияют такие факторы, как затраты на баннерную рекламу (тыс. руб., x_1), расходы на мероприятия, осуществляемые с целью привлечения интернет-пользователей на сайт аукциона (тыс. руб., x_2), и число зарегистрированных пользователей сайта (x_3). Поэтому было решено построить модель множественной регрессии, отражающую зависимость количества покупок от указанных факторов, но предварительно нужно исследовать факторы на мультиколлинеарность и в случае наличия мультиколлинеарности факторов построить гребневую регрессию для оценки параметров модели. Данные об этих показателях за последние 20 месяцев представлены в табл. 7.

Таблица 7

| t | y | x_1 | x_2 | x_3 | t | y | x_1 | x_2 | x_3 |
|-----|-----|-------|-------|-------|-----|-----|-------|-------|-------|
| 1 | 535 | 8,39 | 30,31 | 985 | 11 | 561 | 6,58 | 23,78 | 772 |
| 2 | 515 | 6,83 | 24,68 | 802 | 12 | 388 | 4,48 | 16,17 | 525 |
| 3 | 382 | 5,54 | 20,00 | 650 | 13 | 630 | 7,41 | 26,76 | 869 |
| 4 | 721 | 8,47 | 30,59 | 994 | 14 | 769 | 8,55 | 30,88 | 1003 |
| 5 | 276 | 6,13 | 22,13 | 719 | 15 | 470 | 5,52 | 19,95 | 648 |
| 6 | 513 | 5,77 | 20,85 | 677 | 16 | 511 | 6,01 | 21,7 | 705 |
| 7 | 664 | 7,80 | 28,18 | 915 | 17 | 549 | 6,19 | 22,36 | 726 |
| 8 | 409 | 4,80 | 17,35 | 563 | 18 | 531 | 8,85 | 31,96 | 1038 |
| 9 | 537 | 5,42 | 19,57 | 636 | 19 | 499 | 7,21 | 26,05 | 846 |
| 10 | 794 | 9,31 | 33,62 | 1092 | 20 | 503 | 5,99 | 21,65 | 703 |

Задание 8. Известно, что стоимость выпуска газеты в значительной степени определяется величиной типографских расходов. Для того чтобы иметь возможность воздействовать на эту стоимость, издатели наиболее популярных газет решили изучить факторы, определяющие сумму годовых затрат на печать газет, и оценить степень их влияния. С этой целью для 20 городов России были собраны данные о годовых расходах на печать (y , млн. руб.), объемах розничной продажи газет в городе (млн. руб.) и количества семей в городе (в тысячах). Заметим, что для факторов были взяты их логарифмы (x_1 и x_2 , соответственно) с целью уменьшения разброса данных, а следовательно, и упрощения их обработки. Все эти данные представлены в табл. 8. Постройте модель множественной регрессии, отражающую зависимость среднегодовых расходов на издание газеты от соответствующих факторов, предварительно проверив факторы на мультиколлинеарность. Если эффект мультиколлинеарности выявится, то при построении регрессии необходимо использовать процедуру ридж-оценивания параметров регрессии.

Таблица 8

| № п.п. | y | x_1 | x_2 | № п.п. | y | x_1 | x_2 |
|--------|-----|-------|-------|--------|-----|-------|-------|
| 1. | 2,8 | 4,4 | 3,00 | 11. | 2,7 | 4,24 | 2,89 |
| 2. | 2,3 | 3,68 | 2,51 | 12. | 2,9 | 4,72 | 3,22 |
| 3. | 2,5 | 3,92 | 2,67 | 13. | 3,3 | 5,28 | 3,6 |
| 4. | 2,7 | 4,32 | 2,94 | 14. | 2,7 | 4,24 | 2,89 |
| 5. | 2,6 | 4,24 | 2,89 | 15. | 1,8 | 3,04 | 2,07 |
| 6. | 2,4 | 3,76 | 2,56 | 16. | 1,9 | 3,12 | 2,13 |
| 7. | 3,5 | 5,52 | 3,76 | 17. | 2,2 | 3,6 | 2,46 |
| 8. | 2,1 | 3,36 | 2,29 | 18. | 2,3 | 3,68 | 2,51 |
| 9. | 1,9 | 3,04 | 2,07 | 19. | 3,6 | 5,76 | 3,92 |
| 10. | 3,8 | 5,92 | 4,03 | 20. | 2,2 | 3,6 | 2,45 |

Лабораторный практикум по теме
«Обобщенная схема регрессионного анализа»

Задание 9. В табл. 9 приведены числовые данные о государственных расходах на образование (y , млрд. у.е.) и валовом внутреннем продукте (x , млрд. у.е.) для 34 стран. Проверьте эти данные на наличие гетероскедастичности, используя критерий Голдфельда – Квандта. В случае подтверждения гипотезы о присутствии гетероскедастичности примените для построения модели, отражающей зависимость расходов на образование от ВВП, взвешенный метод наименьших квадратов.

Таблица 9

| № | y | x | № | y | x |
|-----|------|-------|-----|--------|---------|
| 1. | 0,34 | 5,67 | 18. | 5,31 | 101,65 |
| 2. | 0,22 | 10,13 | 19. | 6,40 | 115,97 |
| 3. | 0,32 | 11,34 | 20. | 7,15 | 119,49 |
| 4. | 1,23 | 18,88 | 21. | 11,22 | 124,15 |
| 5. | 1,81 | 20,94 | 22. | 8,66 | 140,98 |
| 6. | 1,02 | 22,16 | 23. | 5,56 | 153,85 |
| 7. | 1,27 | 23,83 | 24. | 13,41 | 169,38 |
| 8. | 1,07 | 24,67 | 25. | 5,46 | 186,33 |
| 9. | 0,67 | 27,56 | 26. | 4,79 | 211,78 |
| 10. | 1,25 | 27,57 | 27. | 8,92 | 249,72 |
| 11. | 0,75 | 40,15 | 28. | 18,90 | 261,41 |
| 12. | 2,80 | 51,62 | 29. | 15,95 | 395,52 |
| 13. | 4,90 | 57,71 | 30. | 29,90 | 534,97 |
| 14. | 3,50 | 63,03 | 31. | 33,59 | 655,29 |
| 15. | 4,45 | 66,32 | 32. | 38,62 | 815,00 |
| 16. | 1,60 | 66,97 | 33. | 61,61 | 1040,45 |
| 17. | 4,26 | 76,88 | 34. | 181,30 | 2586,40 |

Задание 10. Проверьте данные, представленные в табл. 10, на наличие гетероскедастичности, используя тест: 1) Уайта; 2) Бреуша – Пагана.

Таблица 10

| № п.п. | x | y | № п.п. | x | y |
|--------|-------|--------|--------|-------|--------|
| 1. | 10,00 | 110,00 | 11. | 15,00 | 111,64 |
| 2. | 10,50 | 110,66 | 12. | 15,50 | 119,65 |
| 3. | 11,00 | 110,06 | 13. | 16,00 | 126,36 |
| 4. | 11,50 | 112,83 | 14. | 16,50 | 125,12 |

| | | | | | |
|-----|-------|--------|-----|-------|--------|
| 5. | 12,00 | 112,92 | 15. | 17,00 | 121,76 |
| 6. | 12,50 | 113,17 | 16. | 17,50 | 125,98 |
| 7. | 13,00 | 108,35 | 17. | 18,00 | 122,87 |
| 8. | 13,50 | 120,18 | 18. | 18,50 | 117,34 |
| 9. | 14,00 | 115,07 | 19. | 19,00 | 109,94 |
| 10. | 14,50 | 117,08 | 20. | 19,50 | 120,50 |

Задание 11. В табл. 11 приведены данные о государственных расходах (G , млрд. долл.), инвестициях (I , млрд. долл.), валовом внутреннем продукте (Y , млрд. долл.) для 30 стран. Исследователь изучает, происходит ли «вытеснение» инвестиций государственными расходами. С этой целью ему необходимо построить регрессионное уравнение, отражающее зависимость величины инвестиций от государственных расходов и ВВП. Выполните задачу, поставленную перед исследователем. Проведите тестирование ошибок уравнения множественной регрессии на гетероскедастичность. Указание: используйте тест Голдфелда – Квандта, упорядочив данные по возрастанию Y . В случае обнаружения гетероскедастичности постройте регрессионное уравнение, применив взвешенный МНК.

Таблица 11

| Страна | I | G | Y | Страна | I | G | Y |
|-------------|--------|-------|--------|----------------|--------|--------|--------|
| Австралия | 94,5 | 75,5 | 407,9 | Нидерланды | 73,0 | 49,9 | 360,5 |
| Австрия | 46,0 | 39,2 | 206,0 | Новая Зеландия | 12,9 | 9,9 | 65,1 |
| Канада | 119,3 | 125,1 | 631,2 | Норвегия | 35,3 | 30,9 | 153,4 |
| Чехия | 16,0 | 10,5 | 52,0 | Филиппины | 20,1 | 10,7 | 82,2 |
| Дания | 34,2 | 42,9 | 169,3 | Польша | 28,7 | 23,4 | 135,6 |
| Финляндия | 20,2 | 25,0 | 121,5 | Португалия | 25,6 | 19,9 | 102,1 |
| Франция | 255,9 | 347,2 | 1409,2 | Россия | 84,7 | 94,0 | 436,0 |
| Германия | 422,5 | 406,7 | 2102,7 | Сингапур | 35,6 | 9,0 | 95,9 |
| Греция | 24,0 | 17,7 | 119,9 | Испания | 109,5 | 86,0 | 532,0 |
| Исландия | 1,4 | 1,5 | 7,5 | Швеция | 31,2 | 58,8 | 227,8 |
| Ирландия | 14,3 | 10,1 | 73,2 | Швейцария | 50,2 | 38,7 | 256,0 |
| Италия | 190,8 | 189,7 | 1145,4 | Таиланд | 48,1 | 15,0 | 153,9 |
| Япония | 1105,9 | 376,3 | 3901,3 | Турция | 50,2 | 23,3 | 189,1 |
| Южная Корея | 154,9 | 49,3 | 442,5 | Великобритания | 210,1 | 230,7 | 1256,0 |
| Малайзия | 41,6 | 10,8 | 97,3 | США | 1517,7 | 1244,1 | 8110,9 |

Задание 12. Госпожа Арешникова В.В., президент компании «Преслава», собрала данные о месячных объемах продаж своей компании (y_t , тыс. руб.) вместе с несколькими другими показателями, как она полагала, способными оказывать влияние на объем продаж. В качестве этих показателей ею были выбраны расходы на рекламу (x_{1t} , тыс. руб.) и индекс потребительских расходов (x_{2t} , %). Собранные госпожой Арешниковой В.В. данные представлены в табл. 12. Требуется оценить степень взаимосвязи между этими показателями, построив соответствующее линейное уравнение регрессии. Для построенного уравнения следует проверить гипотезу о наличии автокорреляции в остатках. В случае подтверждения этой гипотезы необходимо оценить параметры регрессии обобщенным МНК и получить прогнозную оценку объема продаж на следующий месяц при условии того, что расходы на рекламу составят 7,9 тыс. руб., а индекс потребительских расходов возрастет до 114,9 %.

Таблица 12

| t | y_t | x_{1t} | x_{2t} | t | y_t | x_{1t} | x_{2t} |
|-----|-------|----------|----------|-----|-------|----------|----------|
| 1 | 252 | 4,0 | 97,9 | 10 | 734 | 14,6 | 109,2 |
| 2 | 274 | 5,8 | 98,4 | 11 | 642 | 10,2 | 110,1 |
| 3 | 296 | 4,6 | 101,2 | 12 | 614 | 8,5 | 110,7 |
| 4 | 382 | 6,7 | 103,5 | 13 | 662 | 6,2 | 110,3 |
| 5 | 548 | 8,7 | 104,1 | 14 | 690 | 8,4 | 111,8 |

| | | | | | | | |
|---|-----|------|-------|----|-----|-----|-------|
| 6 | 740 | 8,2 | 107 | 15 | 728 | 8,1 | 112,3 |
| 7 | 764 | 9,7 | 107,4 | 16 | 768 | 6,9 | 112,9 |
| 8 | 790 | 12,7 | 108,5 | 17 | 791 | 7,5 | 113,1 |
| 9 | 734 | 13,5 | 108,3 | 18 | 832 | 7,7 | 113,4 |

Задание 13. Аналитику Воронежского филиала энергетической компании было поручено разработать новые тарифы на электроэнергию, для чего ему потребовалось составить прогноз расходов населения на электроэнергию на следующий период. С этой целью он решил исследовать две потенциально независимые переменные: цена на электроэнергию для физических лиц (коп. за квт/ч, x_1) и потребление электроэнергии населением (квт/ч, x_2). Ему удалось собрать данные по этим показателям за 20 периодов (см. табл. 13).

Таблица 13

| t | y | x_1 | x_2 | t | y | x_1 | x_2 |
|-----|--------|-------|-------|-----|--------|-------|-------|
| 1 | 28,95 | 1,33 | 7803 | 11 | 113,60 | 2,74 | 10863 |
| 2 | 41,70 | 1,58 | 8109 | 12 | 127,80 | 2,65 | 11679 |
| 3 | 51,30 | 1,92 | 8874 | 13 | 136,95 | 3,15 | 11679 |
| 4 | 70,05 | 1,96 | 9333 | 14 | 142,20 | 3,25 | 12087 |
| 5 | 66,75 | 1,98 | 9139 | 15 | 152,25 | 3,25 | 12648 |
| 6 | 81,45 | 2,05 | 10047 | 16 | 154,05 | 3,85 | 13005 |
| 7 | 77,40 | 2,16 | 9730 | 17 | 153,23 | 3,97 | 13056 |
| 8 | 97,80 | 2,34 | 10302 | 18 | 181,60 | 3,97 | 14433 |
| 9 | 107,70 | 2,56 | 10557 | 19 | 186,30 | 4,13 | 14535 |
| 10 | 111,90 | 2,62 | 10812 | 20 | 195,40 | 4,35 | 14851 |

Когда аналитик делал доклад на комиссии по тарифам, ему был задан вопрос: «Так как данные представляют временной ряд, то не будут ли Ваши расчеты искажены автокорреляцией в остатках?» Ответьте на этот вопрос и рассчитайте прогнозную оценку расходов населения на электроэнергию на следующий период при условии того, что цена на электроэнергию составит 4,34 коп. за квт/ч, а потребление электроэнергии – 14905 квт.

Лабораторный практикум по теме «Моделирование временных рядов»

Задача 14. Ежемесячно фирма «Канцелярская ниша» на основе информации об объемах продаж составляет планы закупок отдельных групп товаров для своих магазинов. В текущем месяце на ее складе заканчиваются цветные карандаши, в связи с этим, отделу закупок фирмы было поручено определить количество упаковок, которое необходимо заказать на оптовой базе канцтоваров. Специалисты отдела закупок обычно принимают решение на основе предоставляемой аналитическим отделом информации о прогнозных оценках объемов продаж на последующие три месяца. Аналитическому отделу фирмы предстоит решить три задачи:

- 1) подобрать кривую роста (трендовую модель) к временному ряду табл.14, отражающему динамику объема продаж цветных карандашей фирмой за последние 15 месяцев;
- 2) с помощью критерия Дарбина – Уотсона проверить адекватность выбранной для целей прогнозирования модели;
- 3) получить точечные и интервальные прогнозы объема продаж на 3 месяца. Требуется решить поставленные перед аналитическим отделом фирмы задачи.

Таблица 14

Динамика объема продаж фирмы «Канцелярская ниша»

| Месяц | Альбомы, шт. | Карандаши, упаковок | Маркеры, шт. |
|-------|--------------|---------------------|--------------|
|-------|--------------|---------------------|--------------|

| | | | |
|----|------|------|------|
| 1 | 1268 | 801 | 1565 |
| 2 | 1316 | 859 | 1681 |
| 3 | 1355 | 938 | 1819 |
| 4 | 1370 | 1015 | 1964 |
| 5 | 1385 | 1106 | 2119 |
| 6 | 1396 | 1211 | 2243 |
| 7 | 1402 | 1326 | 2352 |
| 8 | 1406 | 1445 | 2419 |
| 9 | 1408 | 1582 | 2441 |
| 10 | 1411 | 1722 | 2413 |
| 11 | 1412 | 1880 | 2309 |
| 12 | 1416 | 2045 | 2115 |
| 13 | 1417 | 2219 | 1842 |
| 14 | 1418 | 2404 | 1460 |
| 15 | 1421 | 2589 | 970 |

Задача 15. По данным табл. 14 для каждого товара, кроме цветных карандашей, определить тип роста временного ряда, отражающего динамику соответствующего объема продаж. Применяя среднеквадратический критерий, определить среди функций, используемых для моделирования данного типа роста, наиболее подходящую для прогнозных расчетов. С помощью критерия Дарбина – Уотсона проверить адекватность прогнозной модели и получить точечные и интервальные прогнозы на четыре периода.

Задача 16. В данных табл. 15, отражающих динамику объема продаж семян фирмой «Любимцы греческих богов», явно просматривается сезонность. Постройте прогнозную модель с аддитивной сезонной компонентой и получите с ее помощью прогнозные оценки объема продаж на 2022 г. В процессе моделирования постройте график траекторий тренда, исходного временного ряда и сезонной модели.

Таблица 15

| Год | Сезон | Объем продаж, тыс. руб. | Год | Сезон | Объем продаж, тыс. руб. |
|------|-------|-------------------------|------|-------|-------------------------|
| 2018 | зима | 200 | 2020 | зима | 450 |
| | весна | 600 | | весна | 1340 |
| | лето | 140 | | лето | 330 |
| | осень | 30 | | осень | 120 |
| 2019 | зима | 310 | 2021 | зима | 620 |
| | весна | 940 | | весна | 1890 |
| | лето | 230 | | лето | 470 |
| | осень | 70 | | осень | 140 |

Задача 17. Фирма «Теплый кров», занимающаяся остеклением лоджий и балконов, оказывает услуги населению г. Воронежа в объемах, указанных в табл. 16. Для составления стратегически верного бизнес-плана на 2022 г. фирме необходимо рассчитать прогнозную оценку объема услуг на этот год. Получите графическое представление фактических данных с целью выбора типа прогнозной модели (аддитивной или мультипликативной). Постройте модель сезонных колебаний и с ее помощью рассчитайте прогнозные оценки на указанный период. Расчеты представьте в виде таблиц. Постройте совмещенный график для траекторий фактического ряда динамики, тренда и модели.

Таблица 16

| Год | Период | Объем услуг, тыс. руб. | Год | Период | Объем услуг, тыс. руб. |
|------|--------|------------------------|------|--------|------------------------|
| 2016 | 1 | 5910 | 2019 | 1 | 10650 |
| | 2 | 3260 | | 2 | 5210 |
| 2017 | 1 | 6860 | 2020 | 1 | 10960 |
| | 2 | 4300 | | 2 | 6470 |
| 2018 | 1 | 8880 | 2021 | 1 | 12710 |
| | 2 | 4910 | | 2 | 7870 |

Лабораторный практикум по теме
«Динамические эконометрические модели»

Задача 18. Компания «Автоматика», как и любая другая компания, желающая добиться успеха в мире современного бизнеса, с целью увеличения своей прибыли периодически проводит маркетинговые исследования, ориентированные на выявление изменений в предпочтениях потребителей, а также анализ динамики рыночной конъюнктуры. Данные, отражающие зависимость прибыли компании от расходов на маркетинговые исследования, представлены в табл.1. Руководство этой компании заинтересовано в получении ответа на вопрос: какой эффект дает дополнительное вложение в маркетинговые исследования одной тысячи рублей и каков средний лаг, существующий между вложением средств в маркетинговые исследования и получением прибыли от этих вложений.

Таблица 17

| Период | Прибыль компании, тыс. руб. | Расходы на маркетинговые исследования, тыс. руб. | Период | Прибыль компании, тыс. руб. | Расходы на маркетинговые исследования, тыс. руб. |
|--------|-----------------------------|--|--------|-----------------------------|--|
| 1 | 1088 | 80 | 11 | 1381 | 98 |
| 2 | 1135 | 86 | 12 | 1353 | 87 |
| 3 | 1189 | 93 | 13 | 1402 | 94 |
| 4 | 1182 | 87 | 14 | 1482 | 114 |
| 5 | 1173 | 74 | 15 | 1526 | 103 |
| 6 | 1226 | 85 | 16 | 1568 | 101 |
| 7 | 1277 | 95 | 17 | 1613 | 103 |
| 8 | 1334 | 103 | 18 | 1693 | 106 |
| 9 | 1365 | 103 | 19 | 1712 | 108 |
| 10 | 1358 | 94 | 20 | 1728 | 103 |

Задача 19. Совет директоров крупной компании «Эксклюзив», имеющей возможности для увеличения степени компьютеризации управления производством, для реализации своих стратегических планов желал бы иметь представление о том, на сколько и когда могут снизиться производственные затраты при росте степени компьютеризации на 1% в текущем периоде. Очевидно, что для ответа на этот вопрос целесообразно воспользоваться регрессионной моделью с распределенными лагами. Постройте такого рода модель с лагом, равным четырем, в предположении, что структура лага описывается полиномом третьей степени. Данные для построения модели представлены в табл.2.

Таблица 18

| Год | Производственные затраты, тыс. руб. | Степень компьютеризации управления производством, % | Год | Производственные затраты, тыс. руб. | Степень компьютеризации управления производством, % |
|-----|-------------------------------------|---|-----|-------------------------------------|---|
| 1 | 1042 | 54,5 | 11 | 919 | 71,1 |
| 2 | 1037 | 60,1 | 12 | 921 | 61,0 |
| 3 | 1031 | 66,7 | 13 | 911 | 67,6 |
| 4 | 1004 | 61,3 | 14 | 892 | 85,2 |
| 5 | 989 | 49,6 | 15 | 875 | 83,8 |
| 6 | 975 | 58,8 | 16 | 857 | 82,7 |
| 7 | 960 | 67,7 | 17 | 860 | 84,2 |
| 8 | 934 | 74,8 | 18 | 863 | 86,9 |
| 9 | 917 | 75,4 | 19 | 845 | 87,7 |
| 10 | 927 | 67,0 | 20 | 829 | 83,7 |

Задача 20. Данные о динамике оборота розничной торговли и потребительских цен региона приведены в табл. 3. Выполните следующие задания:

- 1) постройте автокорреляционную функцию каждого временного ряда и охарактеризуйте структуру рядов;
- 2) используя метод Алмон, оцените параметры модели с распределенным лагом. Длину лага выберите не более 4, степень аппроксимирующего полинома - не более 3. Оцените качество построенной модели;
- 3) используя метод Койка, оцените параметры модели с распределенным лагом. Длину лага выберите не более 4;
- 4) сравните результаты, полученные в 2) и 3).

Таблица 19

| Год | Месяц | Оборот розничной торговли, % к предыдущему месяцу | Индекс потребительских цен, % к предыдущему году | Год | Месяц | Оборот розничной торговли, % к предыдущему месяцу | Индекс потребительских цен, % к предыдущему году |
|------|----------|---|--|------|----------|---|--|
| 2018 | Январь | 70,8 | 101,7 | 2019 | Январь | 74,3 | 110,0 |
| | Февраль | 98,7 | 101,1 | | Февраль | 92,9 | 106,4 |
| | Март | 97,9 | 100,4 | | Март | 106,0 | 103,2 |
| | Апрель | 99,6 | 100,1 | | Апрель | 99,8 | 103,2 |
| | Май | 96,1 | 100,0 | | Май | 105,2 | 102,9 |
| | Июнь | 103,4 | 100,1 | | Июнь | 99,7 | 100,8 |
| | Июль | 95,5 | 100,0 | | Июль | 99,7 | 101,6 |
| | Август | 102,9 | 105,8 | | Август | 107,9 | 101,5 |
| | Сентябрь | 77,6 | 145,0 | | Сентябрь | 98,8 | 101,4 |
| | Октябрь | 102,3 | 99,8 | | Октябрь | 104,6 | 101,7 |
| | Ноябрь | 102,9 | 102,7 | | Ноябрь | 106,4 | 101,7 |
| | Декабрь | 123,1 | 109,4 | | Декабрь | 122,7 | 101,2 |

Описание технологии проведения

Обучающиеся выполняют лабораторные задания с использованием табличного процессора Excel, пакета «Анализ данных»; оформляют отчет о выполнении задания, в котором приводится развернутое пояснение этапов решения задания и дается содержательная интерпретация полученных результатов.

Требования к выполнению заданий (или шкалы и критерии оценивания)

Для оценивания лабораторного задания используется шкала:
«зачтено», «не зачтено»

Критерии оценивания лабораторного задания:

- оценка «зачтено» - решение задания проведено с использованием табличного процессора Excel; задание выполнено полностью; оформлен отчет о выполнении задания в виде текстового файла и файла Excel, в которых изложены и представлены все этапы решения и дана содержательная интерпретация полученных результатов, сформулированы аналитические выводы;

- оценка «не зачтено» - если задание не выполнено, или нет отчета о выполнении задания, или отчет представлен не полностью: в нем нет развернутого описания этапов решения или отсутствует содержательная

интерпретация полученных результатов, нет аналитических выводов.

Тест 1 по теме «Парная регрессия и корреляция»

1. Какой вывод следует из равенства коэффициента корреляции 0?
 - 1) между показателем и фактором нет зависимости;
 - 2) между показателем и фактором нет линейной зависимости;
 - 3) между показателем и фактором есть зависимость, но нелинейная.

2. Каковы возможные границы изменения коэффициента корреляции?
 - 1) $-1 \leq r \leq 1$;
 - 2) $-1 < r < 1$;
 - 3) $0 \leq r \leq 1$.

3. Каковы возможные границы изменения индекса корреляции?
 - 1) $-1 \leq r \leq 1$;
 - 2) $-1 < r < 1$;
 - 3) $0 \leq r \leq 1$.

4. В каком случае модель считается адекватной?
 - 1) $F_{расч} > F_{табл}$;
 - 2) $F_{расч} < F_{табл}$;
 - 3) значение коэффициента корреляции $> 0,8$.

5. Сравнимы ли между собой линейная и нелинейная модели по коэффициенту корреляции?
 - 1) нет;
 - 2) да;
 - 3) сравнимы, если коэффициент корреляции рассчитан после приведения нелинейной модели к линейной форме.

6. Каким критерием необходимо пользоваться при выборе лучшей регрессионной модели?
 - 1) коэффициентом корреляции между x и y ;
 - 2) суммой квадратов отклонений расчетных значений от фактических;
 - 3) индексом корреляции.

7. Что следует предпринять, если значение коэффициента корреляции близко к 0?
 - 1) принять решение об отсутствии связи между x и y ;
 - 2) перейти к построению многофакторной модели, включив в модель дополнительные факторы;
 - 3) перейти к построению нелинейной модели.

8. Как интерпретируется в линейной модели коэффициент регрессии b_1 ?
 - 1) коэффициент эластичности;
 - 2) коэффициент относительного роста;
 - 3) коэффициент абсолютного роста.

9. Как в показательной модели интерпретируется коэффициент регрессии b_1 ?
 - 1) коэффициент эластичности;
 - 2) коэффициент относительного роста;
 - 3) коэффициент абсолютного роста.

10. Как в степенной модели интерпретируется коэффициент регрессии b_1 ?
- 1) коэффициент эластичности;
 - 2) коэффициент относительного роста;
 - 3) коэффициент абсолютного роста.
11. Применим ли метод наименьших квадратов для расчета параметров нелинейных моделей?
- 1) нет;
 - 2) да;
 - 3) применим после ее специального приведения к линейному виду.
12. Применим ли метод наименьших квадратов для расчета параметров показательной зависимости?
- 1) нет;
 - 2) да;
 - 3) применим после ее приведения к линейному виду путем логарифмирования.
13. Применим ли метод наименьших квадратов для расчета параметров степенной зависимости?
- 1) нет;
 - 2) да;
 - 3) применим после ее приведения к линейному виду путем логарифмирования.
14. Что показывает коэффициент абсолютного роста?
- 1) на сколько единиц изменится y , если x изменился на единицу;
 - 2) на сколько процентов изменится y , если x изменился на один процент;
 - 3) относительную величину изменения y при изменении x на единицу.
15. Что показывает коэффициент регрессии показательной модели?
- 1) на сколько единиц изменится y , если x изменился на единицу;
 - 2) на сколько процентов изменится y , если x изменился на один процент;
 - 3) относительную величину изменения y при изменении x на единицу.
16. Что показывает коэффициент регрессии степенной модели?
- 1) на сколько единиц изменится y , если x изменился на единицу;
 - 2) на сколько процентов изменится y , если x изменился на один процент;
 - 3) относительную величину изменения y при изменении x на единицу.
17. Какой коэффициент рассчитывается по формуле $k = b_1 \cdot \frac{x}{y}$ в случае линейной зависимости?
- 1) коэффициент абсолютного роста;
 - 2) коэффициент относительного роста;
 - 3) коэффициент эластичности.
18. В каком случае линейная модель пригодна для использования в аналитических целях?
- 1) $F_{расч} > F_{табл}$;
 - 2) $F_{расч} < F_{табл}$;
 - 3) при отличии от нуля коэффициента корреляции.
19. Величина коэффициента абсолютного роста b_1 зависит в линейной модели от:
- 1) масштаба измерения y и x ;
 - 2) масштаба измерения только x ;

- 3) не зависит.
20. Величина коэффициента эластичности зависит от:
- 1) масштаба измерения y и x ;
 - 2) масштаба измерения только x ;
 - 3) не зависит.
21. Какую модель следует выбрать, если есть основание считать, что в изучаемом периоде коэффициент абсолютного роста не изменяется?
- 1) линейную;
 - 2) показательную;
 - 3) степенную.
22. Какую модель следует выбрать, если есть основание считать, что в изучаемом периоде коэффициент относительного роста не изменяется?
- 1) линейную;
 - 2) показательную;
 - 3) степенную.
23. Какую модель следует выбрать, если есть основание считать, что в изучаемом периоде коэффициент эластичности не изменяется?
- 1) линейную;
 - 2) показательную;
 - 3) степенную.
24. Если коэффициент корреляции положителен, то в линейной модели:
- 1) с ростом x уменьшается y ;
 - 2) с ростом x увеличивается y ;
 - 3) с уменьшением x растет y .
25. Если коэффициент корреляции отрицателен, то в линейной модели:
- 1) с ростом x уменьшается y ;
 - 2) с ростом x увеличивается y ;
 - 3) с уменьшением x уменьшается y .

Тест 2 по теме «Множественная регрессия и корреляция»

1. Если множественный коэффициент корреляции равен 0, то можно ли считать правильным утверждение: между показателем и факторами нет зависимости?
 - 1) да;
 - 2) нет.
2. Правильно ли записаны границы возможных значений множественного коэффициента корреляции: $-1 \leq r \leq 1$.
 - 1) да;
 - 2) нет.
3. Можно ли утверждать, что значение скорректированного с учетом степеней свободы значения множественного коэффициента корреляции, не превосходит значения множественного коэффициента корреляции?
 - 1) да;
 - 2) нет.
4. Может ли скорректированный коэффициент множественной детерминации оказаться отрицательным?
 - 1) да;
 - 2) нет.
5. Существует ли взаимосвязь между индексом множественной корреляции и F -критерием?
 - 1) да;
 - 2) нет.

6. Зависят ли коэффициенты уравнения регрессии от того, в каких единицах измерены факторы?
- 1) да;
 - 2) нет.
7. Можно ли коэффициенты регрессии использовать для ранжирования факторов по степени их влияния на моделируемый показатель?
- 1) да;
 - 2) нет.
8. Вычисляются ли коэффициенты регрессии через стандартизованные коэффициенты регрессии?
- 1) да;
 - 2) нет.
9. Определяются ли бетта-коэффициенты по коэффициентам регрессии?
- 1) да;
 - 2) нет.
10. Можно ли использовать бетта-коэффициенты для расчета коэффициента множественной корреляции?
- 1) да;
 - 2) нет.
11. С помощью какого критерия оценивается значимость коэффициентов регрессии?
- 1) хи-квадрат;
 - 2) F -критерия;
 - 3) t -Стьюдента.
12. Можно ли с помощью частного F -критерия оценить статистическую значимость отдельного фактора?
- 1) да;
 - 2) нет.
13. Какое свойство ненаблюдаемой случайной составляющей регрессии обеспечивает несмещенность получаемых с помощью МНК оценок?
- 1) некоррелированность;
 - 2) равенство дисперсий;
 - 3) равенство нулю математического ожидания.
14. Что используется в качестве дисперсии в ковариационной матрице векторной оценки регрессионных коэффициентов?
- 1) дисперсия ненаблюдаемой случайно величины;
 - 2) дисперсия остатков;
 - 3) дисперсия зависимой переменной.
15. Что принимается за стандартные ошибки коэффициентов регрессии?
- 1) элементы первой строки ковариационной матрицы векторной оценки регрессионных коэффициентов;
 - 2) диагональные элементы ковариационной матрицы векторной оценки регрессионных коэффициентов;
 - 3) корни квадратные из диагональных элементов ковариационной матрицы векторной оценки регрессионных коэффициентов.
16. Используются ли стандартные ошибки коэффициентов регрессии при оценке адекватности уравнения регрессии?
- 1) да;
 - 2) нет.
17. Обеспечивает ли МНК получение оценок регрессионных коэффициентов с наименьшими стандартными ошибками?
- 1) да;
 - 2) нет.

Описание технологии проведения

Обучающиеся выполняют выданные тестовые задания в течение 30 минут. Ответ на вопрос теста предполагает выбор верной альтернативы из предложенных вариантов. Некоторые вопросы допускают выбор нескольких вариантов ответов.

Требования к выполнению заданий (или шкалы и критерии оценивания)

Для оценивания тестовых заданий используется 4-балльная шкала: «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», «неудовлетворительно»

Критерии оценивания тестовых заданий:

Оценка «отлично» выставляется обучающемуся, если даны правильные ответы на 86-100% тестовых заданий, т.е. на 22-25 вопросов теста 1 и 15-17 вопросов теста 2.

Оценка «хорошо» выставляется обучающемуся, если даны правильные ответы на 70-85% тестовых заданий, т.е. на 18-21 вопрос теста 1 и 12-14 вопросов теста 2.

Оценка «удовлетворительно» выставляется обучающемуся, если даны правильные ответы на 54-69% тестовых заданий, т.е. на 14-17 вопросов теста 1 и 9-11 вопросов теста 2.

Оценка «неудовлетворительно» выставляется обучающемуся, если даны правильные ответы менее чем на 54% тестовых заданий, т.е. на 13 и менее вопросов теста 1 и на 8 и менее вопросов теста 2.

20.2 Промежуточная аттестация

Промежуточная аттестация по дисциплине осуществляется с помощью итогового теста, к выполнению которого обучающийся допускается только после сдачи отчетов о выполнении лабораторных заданий по всем пройденным темам.

Перечень вопросов для подготовки к зачету

1. Однофакторные регрессионные модели и метод их построения
 - 1.1. Общий вид однофакторной регрессии
 - 1.2. Оценка параметров модели методом наименьших квадратов (МНК)
 - 1.3. Оценка качества уравнения регрессии (коэффициенты корреляции и детерминации, дисперсионное отношение Фишера, t-критерий Стьюдента, стандартные ошибки параметров регрессии)
 - 1.4. Нелинейная регрессия; корреляция для нелинейной регрессии
 - 1.5. Содержательная интерпретация параметров регрессионной модели
2. Модель многофакторной регрессии и метод ее построения
 - 2.1. Общий вид модели множественной регрессии
 - 2.2. Отбор факторов при построении множественной регрессии
 - 2.3. Выбор формы уравнения регрессии
 - 2.4. Оценка параметров модели МНК в матричной форме
 - 2.5. Множественная и частная корреляция
 - 2.6. Оценка надежности результатов множественной регрессии
 - 2.7. Фиктивные переменные во множественной регрессии

3. Построение модели множественной регрессии в условиях мультиколлинеарности факторов
 - 3.1. Понятие мультиколлинеарности факторов
 - 3.2. Способы определения эффекта мультиколлинеарности
 - 3.3. Приемы устранения мультиколлинеарности факторов:
 - а) исключение из модели одного или нескольких факторов;
 - б) преобразование факторов;
 - в) метод главных компонент,
 - г) гребневая регрессия или ридж – оценивание.
4. Гетероскедастичность и обобщенная схема регрессионного анализа
 - 4.1. Понятия гетероскедастичности и гомоскедастичности остатков регрессии
 - 4.2. Тесты на гетероскедастичность (тест Уайта, тест Бреуша-Пагана, тест Гольдфельда-Квандта)
 - 4.3. Взвешенный метод наименьших квадратов в условиях гетероскедастичности
5. Построение модели множественной регрессии при наличии автокорреляции в остатках
 - 5.1. Причины автокорреляции в остатках и модели зависимости остатков от времени
 - 5.2. Методика определения автокорреляции в остатках – критерий Дарбина-Уотсона
 - 5.3. Оценка параметров модели регрессии при наличии автокорреляции в остатках
6. Моделирование одномерных временных рядов
 - 6.1. Понятие временного ряда; его основные компоненты
 - 6.2. Типы роста временного ряда и выбор аналитической функции, описывающей тренд:
 - а) постоянный рост;
 - б) увеличивающийся рост;
 - в) уменьшающийся рост;
 - г) рост с качественным изменением динамических характеристик
 - 6.3. Проверка адекватности трендовых моделей
 - 6.4. Аддитивная модель временного ряда
 - 6.5. Мультипликативная модель временного ряда
 - 6.6. Моделирование сезонных колебаний с помощью фиктивных переменных
7. Динамические эконометрические модели
 - 7.1. Общая характеристика моделей с распределенным лагом и моделей авторегрессии.
 - 7.2. Изучение структуры лага и выбор вида модели с распределенным лагом:
 - а) лаги Алмон;
 - б) метод Койка
 - 7.3. Модели авторегрессии. Оценка параметров авторегрессионных моделей методом инструментальных переменных
 - 7.4. Интерпретация параметров моделей с распределенным лагом и моделей авторегрессии

ИТОГОВЫЙ ТЕСТ

Вариант № 1

1. Что следует предпринять, если значение коэффициента корреляции близко к 0?
 - 1) принять решение об отсутствии связи между x и y ;
 - 2) перейти к построению многофакторной модели, включив в модель дополнительные факторы;
 - 3) перейти к построению нелинейной модели.
2. Как в показательной модели интерпретируется коэффициент регрессии b_1 ?
 - 1) коэффициент эластичности;
 - 2) коэффициент относительного роста;
 - 3) коэффициент абсолютного роста.
3. Как в степенной модели интерпретируется коэффициент регрессии b_1 ?
 - 1) коэффициент эластичности;
 - 2) коэффициент относительного роста;
 - 3) коэффициент абсолютного роста.
4. Что показывает коэффициент регрессии линейной модели?
 - 1) на сколько единиц изменится y , если x изменился на единицу;
 - 2) на сколько процентов изменится y , если x изменился на один процент;
 - 3) относительную величину изменения y при изменении x на единицу
5. Каков общий вид модели множественной регрессии?
 - 1) $Y = b_0 + b_1 * x_{1i} + b_2 * x_{2i} + \dots + b_n * x_{ni} + e$
 - 2) $Y = f(X, B) + e$
 - 3) $Y = f(x) + f(b) + e$
6. Какая формула используется для оценки параметров модели множественной линейной регрессии?
 - 1) $\hat{b} = (X' \Omega^{-1} X)^{-1} X' Y$
 - 2) $\hat{b} = (X' X)^{-1} X' Y$
 - 3) $\hat{b} = (X X')^{-1} X' Y$
 - 4) $\hat{b} = (X' X)^{-1} X' Y$
7. С помощью какого критерия оценивается значимость коэффициентов регрессии?
 - 1) хи-квадрат;
 - 2) F -критерия;
 - 3) критерий Дарбина-Уотсона
 - 4) t -статистики Стьюдента
8. Что из перечисленного относится к β – коэффициентам?
 - 1) β – коэффициенты являются стандартизованными коэффициентами регрессии,
 - 2) β – коэффициенты не являются решениями системы нормальных уравнений в стандартизованном масштабе,
 - 3) β – коэффициенты зависят от масштаба измерений зависимых и независимых переменных,
 - 4) β – коэффициенты могут быть использованы для ранжирования факторов по степени их влияния,

9. Что показывают стандартные ошибки коэффициентов регрессии?
- 1) несмещенность оценок коэффициентов регрессии;
 - 2) уровень надежности вычисленных оценок коэффициентов регрессии;
 - 3) математическое ожидание оценок коэффициентов регрессии.
10. Чему равны стандартные ошибки коэффициентов регрессии?
- 1) элементам первой строки ковариационной матрицы векторной оценки регрессионных коэффициентов;
 - 2) диагональным элементам ковариационной матрицы векторной оценки регрессионных коэффициентов;
 - 3) квадратному корню из диагональных элементов ковариационной матрицы векторной оценки регрессионных коэффициентов.
11. Что такое мультиколлинеарность факторов?
- 1) более чем два фактора связаны между собой линейной зависимостью
 - 2) высокая взаимная коррелированность факторов x и показателя y
 - 3) отсутствие взаимной коррелированности объясняющих переменных.
12. Что говорит о наличии мультиколлинеарности?
- 1) определитель матрицы $X'X$ близок к 0
 - 2) определитель матрицы $X'X$ меньше 0
 - 3) определитель матрицы $X'X$ равен 0
 - 4) определитель матрицы $X'X$ больше 0
13. Что такое автокорреляция в остатках
- 1) наличие непостоянной дисперсии остатков между остатками текущих и предыдущих наблюдений.
 - 2) наличие строгой функциональной зависимости между остатками текущих и предыдущих наблюдений.
 - 3) наличие корреляции между остатками текущих и предыдущих наблюдений
14. Выберите ВЕРНЫЕ факты об автокорреляции в остатках:
- 1) она может быть записана, как $M(r(\varepsilon_i, \varepsilon_j)) = 0$
 - 2) она может быть записана, как $M(r(\varepsilon_i, \varepsilon_j)) \neq 0$
 - 3) она может быть записана, как $M(r(\varepsilon_i, \varepsilon_j)) > 0$
 - 4) она может быть записана, как $M(r(\varepsilon_i, \varepsilon_j)) < 0$
15. Какой автокорреляции в остатках НЕ существует?
- 1) положительной
 - 2) отрицательной
 - 3) нулевой
 - 4) постоянной
16. Какой тест предполагает построение неравенства вида $nR^2 > x^2(m-1)$?
- 1) тест Бреуша-Пагана,
 - 2) тест Уайта,
 - 3) тест Голдфельда-Куандта.
17. Какое число соответствует максимальному положительному значению коэффициента Дарбина-Уотсона?
- 1) 0

- 2) 2
- 3) 4

18. Как НЕ МОЖЕТ быть задана автокорреляция в остатках?
- 1) $\varepsilon_t = \varepsilon_{t-1} + u_i$
 - 2) $\varepsilon_t = \rho\varepsilon_{t-1} + u_i$
 - 3) $\varepsilon_t = \varepsilon_{t+1}\rho + u_i$
19. Какой характеристикой временного ряда является средний абсолютный прирост?
- 1) характеристикой, отражающей поведение временного ряда в текущий момент времени;
 - 2) характеристикой, отражающей поведение временного ряда в целом за весь период;
 - 3) характеристикой, отражающей поведение временного ряда в начале и в конце рассматриваемого периода
20. В каком случае рекомендуется применять для моделирования показателей с увеличивающимся ростом параболу?
- 1) если относительная величина прироста увеличивается неограниченно;
 - 2) если абсолютная величина прироста растет по линейному закону;
 - 3) если относительная величина прироста почти неизменна
21. Сумма всех коэффициентов b_j модели с лаговыми переменными называется:
- 1) краткосрочным мультипликатором;
 - 2) промежуточным мультипликатором;
 - 3) долгосрочным мультипликатором.
22. Какой метод основан на предположении о том, что степень влияния лаговой переменной убывает по мере возрастания лага согласно закону, описываемому геометрической прогрессией?
- 1) метод наименьших квадратов;
 - 2) метод Алмон;
 - 3) метод Койка;
 - 4) метод максимального правдоподобия.
23. Метод Койка основан на предположении о том, что степень влияния лаговой переменной убывает по мере возрастания в:
- 1) арифметической последовательности;
 - 2) геометрической последовательности;
 - 3) любой последовательности.
24. Модель Алмон строится в предположении, что:
- 1) значения коэффициентов b_j модели могут быть аппроксимированы полиномами соответствующей степени от величины лага j ;
 - 2) степень влияния лаговой переменной убывает по мере возрастания лага по закону, описываемому арифметической прогрессией;
 - 3) степень влияния лаговой переменной убывает по мере возрастания лага по закону, описываемому геометрической прогрессией.
25. Какой процесс называется авторегрессионным?
- 1) если его текущие значения находятся в линейной зависимости от предыдущих значений;
 - 2) если его текущие значения находятся в линейной зависимости от фактора времени;

- 3) если его текущие значения находятся в линейной зависимости от текущих и предыдущих значений.
26. Как записывается модель авторегрессионного процесса первого порядка?
- 1) $y_t = a_0 + a_1 t + \varepsilon_t$;
 - 2) $y_t = a_0 + a_1 y_{t-1} + \varepsilon_t$
 - 3) $y_t = a_0 + a_1 x_{t-1} + \varepsilon_t$.
27. Аддитивную модель рекомендуется строить, когда амплитуда сезонных колебаний:
- 1) имеет тенденцию к возрастанию или снижению в зависимости от уровня временного ряда;
 - 2) остается практически неизменной во всех циклах;
 - 3) с течением времени затухает.
28. Мультипликативную модель рекомендуется строить, когда амплитуда сезонных колебаний:
- 1) имеет тенденцию к возрастанию или снижению в зависимости от уровня временного ряда;
 - 2) остается практически неизменной во всех циклах;
 - 3) с течением времени затухает.
29. Модель сезонных колебаний в виде множественной регрессии по своей сути представляет:
- 1) разновидность мультипликативной модели временного ряда;
 - 2) разновидность аддитивной модели временного ряда;
 - 3) модель, комбинирующая аддитивное и мультипликативное представление сезонной составляющей временного ряда.

Описание технологии проведения

Обучающиеся выполняют выданные тестовые задания (по вариантам) в течение 45 минут.

Ответ на вопрос теста предполагает выбор верной альтернативы из предложенных вариантов. Некоторые вопросы допускают выбор нескольких вариантов ответов. За каждый правильный ответ на вопрос теста дается один балл. Общее количество баллов соответствует количеству тестовых вопросов.

Требования к выполнению заданий (или шкалы и критерии оценивания)

Для оценивания тестовых заданий используется шкала:
«зачтено», «не зачтено»

Критерии оценивания итогового теста

| Критерии оценивания | Шкала оценок |
|--|--------------|
| Обучающийся демонстрирует в целом знание базовых понятий эконометрики, основ эконометрического моделирования, регрессии и корреляции, обобщенной схемы регрессионного анализа, особенностей моделирования временных рядов, сезонных колебаний и динамических процессов с распределенными лагами; проявил способность достаточно быстро ориентироваться в материале, отвечая на вопросы итогового теста в рамках ограниченного промежутка времени. Количество набранных баллов за итоговый тест составило | Зачтено |

| | |
|---|-------------------|
| <p>18-29.</p> <p>Выполнение лабораторного практикума в полном объеме показало умение строить эконометрические модели разного уровня сложности, способность анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты.</p> <p>Текущая аттестация в тестовом формате закрыта с суммарным оценочным баллом не менее 6.</p> | |
| <p>Обучающийся демонстрирует уровень знаний базовых понятий эконометрики, основ эконометрического моделирования, регрессии и корреляции не достаточный для оценки «зачтено». Количество набранных баллов за итоговый тест составило менее 18.</p> <p>Текущая аттестация в формате отчетов по лабораторному практикуму не зачтена по большей части разделов дисциплины.</p> <p>Текущая аттестация в тестовом формате закрыта с суммарным оценочным баллом менее 6.</p> | <p>Не зачтено</p> |