



МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
**ИНСТИТУТ ТЕХНОЛОГИЙ (ФИЛИАЛ) ФЕДЕРАЛЬНОГО
ГОСУДАРСТВЕННОГО БЮДЖЕТНОГО ОБРАЗОВАТЕЛЬНОГО
УЧРЕЖДЕНИЯ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«ДОНСКОЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ТЕХНИЧЕСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ»
В Г. ВОЛГОДОНСКЕ РОСТОВСКОЙ ОБЛАСТИ**

(Институт технологий (филиал) ДГТУ в г. Волгодонске)

УТВЕРЖДАЮ
И. о. директора



 Н.М. Сидоркина

24 апреля 2023 г.

**ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ
(ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА)**

**для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации
по дисциплине
«Эконометрика»
для обучающихся по направлению подготовки
38.03.01 Экономика
программа бакалавриата «Экономика»
2023 года набора**

Волгодонск
2023

Лист согласования

Оценочные материалы (оценочные средства) по дисциплине «Эконометрика» составлены в соответствии с требованиями Федерального государственного образовательного стандарта высшего образования по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12 ноября 2015 № 1327)

Рассмотрены и одобрены на заседании кафедры «Технический сервис и информационные технологии» протокол № 12 от «3» июля 2023г

Разработчики оценочных материалов (оценочных средств)

Доцент


_____ Е.Н. Климова
подпись
«29» 06 2023г.

И. о. заведующего кафедрой


_____ Н.В. Кочковая
подпись
«3» 02 2023г.

Согласовано:

Представитель работодателя

Директор по продажам АО «Цимлянский судомеханический завод»


_____ Лазурченко Т.О.
подпись
«5» 02 2023г.

Финансовый директор ООО «Мир обоев»


_____ Т.С. Путанашенко
подпись
«5» 02 2023г.

Содержание

С.

1 Паспорт оценочных материалов (оценочных средств)	
1.1 Перечень компетенций, формируемых дисциплиной (модулем), с указанием этапов их формирования в процессе освоения ОПОП	5
1.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования	9
1.3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций, описание шкал оценивания	13
2 Контрольные задания (демоверсии) для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы	13

1 Паспорт оценочных материалов (оценочных средств)

Оценочные материалы (оценочные средства) прилагаются к рабочей программе дисциплины и представляет собой совокупность контрольно-измерительных материалов (типовые задачи (задания), контрольные работы, тесты и др.) и методов их использования, предназначенных для измерения уровня достижения обучающимся установленных результатов обучения.

Оценочные материалы (оценочные средства) используются при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся.

1.1 Перечень компетенций, формируемых дисциплиной, с указанием этапов их формирования в процессе освоения ОПОП

Перечень компетенций, формируемых в процессе изучения дисциплины:

ОПК-2 – способностью осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач;

ПК-1 – способностью собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.

Конечными результатами освоения дисциплины являются сформированные когнитивные дескрипторы «знать», «уметь», «владеть», расписанные по отдельным компетенциям. Формирование дескрипторов происходит в течение всего семестра по этапам в рамках контактной работы, включающей различные виды занятий и самостоятельной работы, с применением различных форм и методов обучения (табл. 1).

Таблица 1 Формирование компетенций в процессе изучения дисциплины

Код компетенции	Уровень освоения	Дескрипторы компетенции (результаты обучения, показатели достижения результата обучения, которые обучающийся может продемонстрировать)	Вид учебных занятий, работы ¹ , формы и методы обучения, способствующие формированию и развитию компетенции ²	Контролируемые разделы и темы дисциплины ³	Оценочные материалы (оценочные средства), используемые для оценки уровня сформированности компетенции	Критерии оценивания компетенций ⁴	
ОПК-2	Знать		Лекции (УО). Практ. занятия ТЗ (выполнение тестовых заданий), ИЗСРС (выполнение индивидуальных заданий для самостоятельной работы студентов)	1.1,2.1-2.3,3.1,4.1	устный опрос, решение задач, выполнение домашних заданий, выполнение тестовых заданий, выполнение заданий для самостоятельной работы студентов	посещаемость занятий; познавательная активность на занятиях, качество подготовки домашних заданий и заданий для самостоятельной работы студентов	
	Уровень 1:	основы регрессионного анализа;					
	Уровень 2:	основы статистического оценивания и анализа точности параметров уравнения регрессии;					
	Уровень 3:	основы анализа и прогнозирования временных рядов.					
	Уметь		Практ. занятия (устный опрос, выполнение заданий и решение задач), СРС (выполнение заданий для			устный опрос, решение задач, выполнение домашних заданий, выполнение тестовых заданий, выполнение заданий для самостоятельной работы	работы студентов по разделам дисциплины, выполнение практических заданий, контрольных
	Уровень 1:	методами первичной обработки и анализа наблюдаемых данных;					
	Уровень 2:	решать типовые задачи в пределах изучаемого программного материала;					

¹ Лекционные занятия, практические занятия, лабораторные занятия, самостоятельная работа

² Необходимо указать активные и интерактивные методы обучения (например, интерактивная лекция, работа в малых группах, методы мозгового штурма, решение творческих задач, работа в группах, проектные методы обучения, ролевые игры, тренинги, анализ ситуаций и имитационных моделей и др.), способствующие развитию у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств

³ Указать номера тем в соответствии с рабочей программой дисциплины

⁴ Необходимо выбрать критерий оценивания компетенции: посещаемость занятий; подготовка к практическим занятиям; подготовка к лабораторным занятиям; ответы на вопросы преподавателя в рамках занятия; подготовка докладов, эссе, рефератов; умение отвечать на вопросы по теме лабораторных работ, познавательная активность на занятиях, качество подготовки рефератов и презентацией по разделам дисциплины, контрольные работы, экзамены, умение делать выводы и др.

	Уровень 3:	оценивать и давать прогноз полученным результатам.	самостоятельной работы студентов)		студентов	работ, умение делать выводы.
	Владеть		Лекции (УО).			
	Уровень 1:	методами обработки и анализа наблюдаемых данных;	Практ. занятия ТЗ (выполнение тестовых заданий),		устный опрос, решение задач, выполнение домашних заданий, выполнение тестовых заданий, выполнение заданий для самостоятельной работы студентов	
	Уровень 2:	методами решения основных эконометрических уравнений;	ИЗСРС			
	Уровень 3:	пониманием исторических предпосылок эконометрики, область применения и степень применимости;	(выполнение индивидуальных заданий для самостоятельной работы студентов)			
ПК-1	Знать			1.1,2.1-2.3,3.1,4.1	устный опрос, решение задач, выполнение домашних заданий, выполнение тестовых заданий, выполнение заданий для самостоятельной работы студентов	посещаемость занятий; познавательная активность на занятиях, качество подготовки домашних заданий и заданий для самостоятельной работы студентов по разделам дисциплины,
	Уровень 1:	основные положения, теоретические основы и прикладные методики для решения основных эконометрических уравнений;	Лекц.			
	Уровень 2:	основы анализа эконометрических моделей, представляющих собой системы одновременных уравнений;	Практ. занятия (устный опрос, выполнение заданий и решение задач), СРС (выполнение заданий для самостоятельной работы студентов)			
	Уровень 3:	основы анализа и прогнозирования временных рядов.				
	Уметь					
	Уровень 1:	использовать основные предпосылки, необходимые для правильного применения классических регрессионных моделей;	Практ. занятия (устный опрос, выполнение заданий и решение задач), СРС (выполнение заданий для			
	Уровень 2:	использовать информационные	заданий для		устный опрос, решение задач, выполнение домашних заданий, выполнение тестовых заданий, выполнение заданий для самостоятельной работы	выполнение практических заданий, контрольных работ, умение делать выводы.

		системы поддержки эконометрических исследований и расчётов;	самостоятельной работы студентов)		студентов	
	Уровень 3:	самостоятельно работать с учебно-методической литературой и электронными учебно-методическими комплексами.				
	Владеть					
	Уровень 1:	владеть математическим, статистическим аппаратом; терминологией и её прикладной интерпретацией;	Практ. занятия (устный опрос, выполнение заданий и решение задач), СРС (выполнение заданий для самостоятельной работы студентов)		устный опрос, решение задач, выполнение домашних заданий, выполнение тестовых заданий, выполнение заданий для самостоятельной работы студентов	
	Уровень 2:	владеть навыками использования пакетов прикладного программного обеспечения эконометрической направленности;				
	Уровень 3:	пониманием изучаемого материала.				

1.2 Описание показателей и критериев оценивания компетенций на различных этапах их формирования, описание шкал оценивания

Оценивание результатов обучения по дисциплине осуществляется в соответствии с Положением о текущем контроле и промежуточной аттестации обучающихся.

По дисциплине «*Эконометрика*» предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль (осуществление контроля всех видов аудиторной и внеаудиторной деятельности обучающегося с целью получения первичной информации о ходе усвоения отдельных элементов содержания дисциплины); промежуточная аттестация (оценивается уровень и качество подготовки по дисциплине в целом).

Текущий контроль в семестре проводится с целью обеспечения своевременной обратной связи, для коррекции обучения, активизации самостоятельной работы обучающихся. Текущий контроль служит для оценки объёма и уровня усвоения обучающимся учебного материала одного или нескольких разделов дисциплины (модуля) в соответствии с её рабочей программой и определяется результатами текущего контроля знаний обучающихся.

Текущий контроль осуществляется два раза в семестр по календарному графику учебного процесса.

Текущий контроль предполагает начисление баллов за выполнение различных видов работ. Результаты текущего контроля подводятся по шкале балльно-рейтинговой системы. Регламент балльно-рейтинговой системы определен Положением о системе «Контроль успеваемости и рейтинг обучающихся».

Текущий контроль является результатом оценки знаний, умений, навыков и приобретенных компетенций обучающихся по всему объёму учебной дисциплины, изученному в семестре, в котором стоит форма контроля в соответствии с учебным планом.

Текущий контроль успеваемости предусматривает оценивание хода освоения дисциплины: теоретических основ и практической части.

При обучении по заочной форме обучения текущий контроль не предусмотрен.

Промежуточная аттестация по дисциплине «*Эконометрика*» проводится в форме экзамена.

В табл. 2 приведено весовое распределение баллов и шкала оценивания по видам контрольных мероприятий.

Таблица 2 Весовое распределение баллов и шкала оценивания по видам контрольных мероприятий

Текущий контроль (50 баллов ⁵)				Промежуточная аттестация (50 баллов)	Итоговое количество баллов по результатам текущего контроля и промежуточной аттестации
Блок 1		Блок 2			
Лекционные занятия (X_1)	Практические занятия (Y_1)	Лекционные занятия (X_2)	Практические занятия (Y_2)	от 0 до 50 баллов	Менее 41 балла – неудовлетворительно; 41-60 баллов – удовлетворительно; 61-80 баллов – хорошо; 81-100 баллов – отлично
10	10	20	10		
Сумма баллов за 1 блок = $X_1 + Y_1 = 20$		Сумма баллов за 2 блок = $X_2 + Y_2 = 30$			

⁵ Вид занятий по дисциплине (лекционные, практические, лабораторные) определяется учебным планом. Количество столбцов таблицы корректируется в зависимости от видов занятий, предусмотренных учебным планом.

Распределение баллов по блокам, по каждому виду занятий в рамках дисциплины определяет преподаватель. Распределение баллов по дисциплине утверждается протоколом заседания кафедры.

По заочной форме обучения мероприятия текущего контроля не предусмотрены.

Для определения фактических оценок каждого показателя выставляются следующие баллы (табл.3):

Таблица 3– Распределение баллов по дисциплине

Вид учебных работ по дисциплине	<i>Количество баллов</i>	
	<i>1 блок</i>	<i>2 блок</i>
<i>Текущий контроль (50 баллов)</i>		
Посещение занятий	2	2
Выполнение заданий по дисциплине (УО, ТЗ, РЗ, ДЗ, ЗСРС), в том числе:	18	28
- устный опрос (УО)	10	20
- выполнение тестовых заданий (ТЗ)	2	2
- выполнение индивидуальных заданий для самостоятельной работы(ИЗСРС)	6	6
	20	30
<i>Промежуточная аттестация (50 баллов)</i>		
Зачет (с оценкой) в письменной форме		
Сумма баллов по дисциплине 100 баллов		

Зачет (с оценкой) является формой итоговой оценки качества освоения обучающимся образовательной программы по дисциплине в целом или по разделу дисциплины. По результатам зачета обучающемуся выставляется оценка «отлично», «хорошо», «удовлетворительно», или «неудовлетворительно».

Оценка «отлично» (81-100 баллов) выставляется обучающемуся, если:

- обучающийся набрал по текущему контролю необходимые и достаточные баллы для выставления оценки автоматом⁶;
- обучающийся знает, понимает основные положения дисциплины, демонстрирует умение применять их для выполнения задания, в котором нет явно указанных способов решения;

⁶ Количество и условия получения необходимых и достаточных для получения автомата баллов определены Положением о системе «Контроль успеваемости и рейтинг обучающихся»

- обучающийся анализирует элементы, устанавливает связи между ними, сводит их в единую систему, способен выдвинуть идею, спроектировать и презентовать свой проект (решение);
- ответ обучающегося по теоретическому и практическому материалу, содержащемуся в вопросах экзаменационного билета, является полным, и удовлетворяет требованиям программы дисциплины;
- обучающийся продемонстрировал свободное владение концептуально-понятийным аппаратом, научным языком и терминологией соответствующей дисциплины;
- на дополнительные вопросы преподавателя обучающийся дал правильные ответы.

Компетенции ОПК-2 и ПК-1 сформированы на высоком уровне (уровень 3) (см. табл. 1).

Оценка «**хорошо**» (61-80 баллов) выставляется обучающемуся, если:

- обучающийся знает, понимает основные положения дисциплины, демонстрирует умение применять их для выполнения задания, в котором нет явно указанных способов решения; анализирует элементы, устанавливает связи между ними;
- ответ по теоретическому материалу, содержащемуся в вопросах экзаменационного билета, является полным, или частично полным и удовлетворяет требованиям программы, но не всегда дается точное, уверенное и аргументированное изложение материала;
- на дополнительные вопросы преподавателя обучающийся дал правильные ответы;
- обучающийся продемонстрировал владение терминологией соответствующей дисциплины.

Компетенции ОПК-2 и ПК-1 сформированы на среднем уровне (уровень 2) (см. табл. 1).

Оценка «**удовлетворительно**» (41-60 баллов) выставляется обучающемуся, если:

- обучающийся знает и воспроизводит основные положения дисциплины в соответствии с заданием, применяет их для выполнения типового задания, в котором очевиден способ решения;
- обучающийся продемонстрировал базовые знания важнейших разделов дисциплины и содержания лекционного курса;
- у обучающегося имеются затруднения в использовании научно-понятийного аппарата в терминологии курса;
- несмотря на недостаточность знаний, обучающийся имеет стремление логически четко построить ответ, что свидетельствует о возможности последующего обучения.

Компетенции ОПК-2 и ПК-1 сформированы на базовом уровне (уровень 1) (см. табл. 1).

Оценка «**неудовлетворительно**» (менее 41 балла) выставляется обучающемуся, если:

- обучающийся имеет представление о содержании дисциплины, но не знает основные положения (темы, раздела, закона и т.д.), к которому относится задание, не способен выполнить задание с очевидным решением, не владеет навыками построения стандартных теоретических и эконометрических моделей, методикой стратегического планирования на примере предприятия;
- у обучающегося имеются существенные пробелы в знании основного материала по дисциплине;
- в процессе ответа по теоретическому материалу, содержащемуся в вопросах экзаменационного билета, допущены принципиальные ошибки при изложении материала.

Компетенция ОПК-2 и ПК-1 не сформированы.

1.3 Методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и опыта деятельности

Оценивание результатов обучения студентов по дисциплине «Эконометрика» осуществляется по регламенту текущего контроля и промежуточной аттестации.

Текущий контроль в семестре проводится с целью обеспечения своевременной обратной связи, для коррекции обучения, активизации самостоятельной работы студентов. Результаты текущего контроля подводятся по шкале балльно - рейтинговой системы, реализуемой в ДГТУ.

Текущий контроль осуществляется два раза в семестр по календарному графику учебного процесса в рамках проведения контрольных точек.

Формы текущего контроля знаний:

- устный опрос (УО);
- выполнение тестовых заданий (ТЗ);
- выполнение индивидуальных заданий для самостоятельной работы студентов (ИЗСРС).

Проработка конспекта лекций и учебной литературы осуществляется студентами в течение всего семестра, после изучения новой темы. Перечень вопросов для устного опроса определен содержанием темы в РПД и методическими рекомендациями по изучению дисциплины.

Защита практических заданий производится студентом в день их выполнения в соответствии с расписанием занятий. Преподаватель проверяет правильность выполнения практического задания студентом, контролирует знание студентом пройденного материала с помощью контрольных вопросов или тестирования.

Оценка компетентности осуществляется следующим образом: в процессе защиты выявляется информационная компетентность в соответствии с практическим заданием, затем преподавателем дается комплексная оценка деятельности студента.

Высокую оценку получают студенты, которые при подготовке материала для самостоятельной работы сумели без ошибок выполнить индивидуальные задания и выучить лекционный материал по рассматриваемой теме, показать понимание связи рассматриваемой темы с современными проблемами науки и общества.

Оценка качества подготовки на основании выполненных заданий ведется преподавателям (с обсуждением результатов), баллы начисляются в зависимости от сложности задания.

Итоговый контроль освоения умения и усвоенных знаний дисциплины «Эконометрика» осуществляется в процессе промежуточной аттестации на экзамене. Условием допуска к экзамену является положительная текущая аттестация по всем практическим работам учебной дисциплины, ключевым теоретическим вопросам дисциплины.

2 Контрольные задания (демоверсии) для оценки знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы

2.1 Задания для оценивания результатов обучения в виде знаний и умений:

2.1.1 Вопросы устного опроса (УО) для оценивания результатов обучения в виде знаний и умений:

1. Классификация эконометрических моделей. Основные этапы построения эконометрических моделей
2. Специфика экономических данных. Зависимые и независимые переменные.

3. Структура и особенности временных рядов экономических показателей.
4. Типы экономических данных, используемых в эконометрических исследованиях: пространственные данные и временные ряды.
5. Требования, предъявляемые к информационной базе временных рядов.
6. Методы обнаружения и устранения аномальных наблюдений во временных рядах.
7. Исследование и моделирование тренд сезонных, сезонных и периодических колебаний в функционировании финансовых рынков.
8. Экстраполяционные методы и модели прогнозирования социально-экономических процессов.
9. Линейная модель парной регрессии. Оценка параметров модели с помощью метода наименьших квадратов (МНК).
10. Матричная форма метода наименьших квадратов. Экономический смысл коэффициентов модели.
11. Оценка существования параметров линейной регрессии. Интервалы прогноза по линейному уравнению регрессии.
12. Нелинейная регрессия. Нелинейные модели и их линеаризация.
13. Кривые Энгеля. Эконометрический подход к оцениванию неизвестных параметров однофакторных функции спроса и производственных функций.
14. Оценка параметров множественной регрессии методом наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК.
15. Методы отбора факторов при построении множественной регрессии.
16. Мультиколлинеарность. Способы её обнаружения, методы её устранения.
17. Корреляционная матрица. Отбор факторов на основе корреляционного анализа.
18. Отбор факторов при построении множественной регрессии. Процедура пошагового отбора переменных.
19. Коэффициенты множественной корреляции и детерминации, критерий Фишера, критерий Стьюдента.
20. Показатели качества регрессии.
21. Оценка параметров множественной регрессии методом наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК.
22. Методы отбора факторов при построении множественной регрессии.
23. Мультиколлинеарность. Способы её обнаружения, методы её устранения.
24. Корреляционная матрица. Отбор факторов на основе корреляционного анализа.
25. Отбор факторов при построении множественной регрессии. Процедура пошагового отбора переменных.
26. Коэффициенты множественной корреляции и детерминации, критерий Фишера, критерий Стьюдента.
27. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные). Нелинейные модели множественной регрессии. Функция Кобба-Дугласа, ее основные характеристики. Показатели качества регрессии.
28. Структура и особенности временных рядов экономических показателей.
29. Требования, предъявляемые к информационной базе временных рядов.
30. Типы экономических данных, используемых в эконометрических исследованиях: пространственные данные и временные ряды.
31. Системы эконометрических уравнений
32. Рекурсивные системы
33. Одновременные уравнения
34. Двухшаговый и трехшаговый метод наименьших квадратов

Критерии оценки устного опроса:

- качество ответов (ответы должны быть полными, четко выстроены, логичными (аргументированными));
- владение научным и профессиональной терминологией.

Шкала оценивания устного опроса.

Каждый вопрос оценивается по следующей шкале:

- 0 баллов - обучающийся дал неправильный ответ на вопрос или не ответил;
- 1-4 балла - ответ обучающегося является не полным, не точным, не уверенным и не аргументированным;
- 5-7 балла – ответ обучающегося является полным, но не точным, не уверенным и не аргументированным;
- 8-10 - ответ обучающегося является полным, точным, уверенным и аргументированным.

По результатам опросов выводится средняя оценка, которая округляется до целой величины и выставляется при первой рейтинговой оценке.

2.1.2 Тестовые задания (ТЗ) для оценивания результатов обучения в виде знаний:

1. Термин «эконометрика» был введен в научный оборот:

- А) В. Парето; Б) Р. Фришем; В) Дж. Кейнсом Г) Гукером.

2. Все переменные в эконометрических моделях делятся на (выберите несколько правильных ответов) :

- А) экзогенные; Б) эндогенные; В) пространственные; Г) предопределенные.

3. Парная регрессия – это:

- А) односторонняя стохастическая зависимость;
 Б) функциональная зависимость;
 В) двухсторонняя стохастическая зависимость;
 Г) детерминированная зависимость.

4. Коэффициент парной регрессии интерпретируется:

- А) в зависимости от экономического смысла задачи. Чаще всего отражает совокупное воздействие на Y неучтенных X -ом факторов;
 Б) как показатель изменения Y при изменении X на единицу измерения признака;
 В) не имеет интерпретации.

5. Стандартная ошибка оценки уравнения регрессии – это:

- А) мера вариации относительно среднего X ;
 Б) мера вариации относительно среднего Y ;
 В) мера вариации относительно линии регрессии.

6. Коэффициент детерминации может быть рассчитан как:

- А) $R^2 = \frac{\text{остаточная сумма квадратов}}{\text{общая сумма квадратов}} = \frac{S_E}{S_T}$;
- Б) $R^2 = \frac{\text{сумма квадратов, объясняемая регрессией}}{\text{остаточная сумма квадратов}} = \frac{S_R}{S_E}$;
- В) $R^2 = \frac{\text{остаточная сумма квадратов}}{\text{сумма квадратов, объясняемая регрессией}} = \frac{S_E}{S_R}$;
- Г) $R^2 = \frac{\text{сумма квадратов, объясняемая регрессией}}{\text{общая сумма квадратов}} = \frac{S_R}{S_T}$.

7. Для проверки качества оценивания регрессии необходимо рассчитать:

А) $\chi^2_{набл.} = \sum \frac{(f_0 - f_E - 0,5)^2}{f_E}$; Б) $t_{n-2} = \frac{b - \beta}{S_b}$; В) $F_{набл.} = \frac{R^2}{(1 - R^2)/(n - 2)}$.

8. Частный коэффициент корреляции характеризует:

- А) тесноту связи между результативным и факторным признаками;
- Б) тесноту связи между результативным и факторным признаками при фиксированном воздействии других факторов, включенных в уравнение регрессии;
- В) тесноту связи между факторными признаками.

9. Для измерения эффекта мультиколлинеарности используют:

А) $VIF(x_h) = \frac{1}{1 - R_h^2}$; Б) $SR_i = \frac{e_i}{S_{yx} \sqrt{1 - h_i}}$; В) $\bar{R}_{yx_1x_2}^2 = 1 - (1 - R_{yx_1x_2}^2) \frac{n-1}{n-m-1}$.

10. Модель временного ряда с аддитивной компонентой выглядит как:

- А) Фактическое значение = Трендовое значение + Сезонная вариация + Ошибка
($A = T + S + E$);
- Б) Фактическое значение = Трендовое значение · Сезонная вариация · Ошибка
($A = T \cdot S \cdot E$);
- В) Фактическое значение = Трендовое значение + Сезонная вариация · Ошибка
($A = T + S \cdot E$).

11. Эконометрика получила свое развитие на стыке следующих наук (выберите несколько правильных ответов) :

А) экономической теории; Б) статистики; В) кибернетики; Г) математики.

12. По уровню иерархии экономической системы, анализируемой при помощи эконометрики, выделяют (выберите несколько правильных ответов):

А) мегауровень; Б) макроуровень; В) мезоуровень; С) микроуровень.

13. Относительно числа явлений (переменных), учитываемых в регрессии различают (выберите несколько правильных ответов) :

А) простую (парную) регрессию; Б) сложную регрессию;
В) множественную регрессию; Г) единственную регрессию.

14. Найденная с помощью Метода Наименьших Квадратов линия регрессии:

А) максимизирует сумму квадратов отклонений e_i ;
Б) минимизирует сумму квадратов отклонений e_i ;
В) оптимизирует сумму квадратов отклонений e_i .

15. Параметр b в модели парной регрессии может быть найден как:

$$\text{А) } b = \frac{\sum_{i=1}^n [(x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})]}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})}; \quad \text{Б) } b = \frac{\sum_{i=1}^n [(x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})]}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}; \quad \text{В) } b = \frac{\sum_{i=1}^n [(x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})]}{\sum_{i=1}^n (y_i - \bar{y})^2}.$$

16. Коэффициент детерминации – это:

А) доля вариации, которая не объясняется зависимыми переменными в регрессионной модели;
Б) доля вариации, которая не объясняется независимыми переменными в регрессионной модели.
В) доля вариации, которая объясняется зависимыми переменными в регрессионной модели;
Г) доля вариации, которая объясняется независимыми переменными в регрессионной модели.

17. Для проверка значимости параметра уравнения β используется:

А) хи- квадрат; Б) F -критерий Фишера; В) t -критерий Стьюдента.

18. Множественный коэффициент детерминации оценивает:

А) степень тесноты связи между результативным признаком и каждым факторным;
Б) совокупное влияние факторных признаков на результативный;

В) какой из факторных признаков в большей степени влияет на результативный.

19. Гомоскедастичность случайных остатков означает, что:

- А) остатки модели e_i имеют постоянную дисперсию;
- Б) распределение остатков e_i является нормальным;
- В) остатки e_i носят случайный характер

20. Критерий Дарбина - Уотсона используется при выявлении:

- А) мультиколлинеарности;
- Б) гомоскедастичности;
- В) гетероскедастичности;
- Г) автокорреляции.

21. Случайная составляющая (ошибка) ε обусловлена:

- А) стохастическим характером зависимости между X и Y ;
- Б) функциональным характером зависимости между X и Y ;
- В) детерминированным характером зависимости между X и Y .

22. При эконометрическом моделировании встречаются следующие типы данных (выберите несколько правильных ответов) :

- А) пространственные данные;
- Б) экзогенные данные;
- В) временные ряды.

23. Свободный член уравнения регрессии интерпретируется:

- А) в зависимости от экономического смысла задачи. Чаще всего отражает совокупное воздействие на Y неучтенных X -ом факторов;
- Б) как показатель изменения Y при изменении X на единицу измерения признака;
- В) не имеет интерпретации.

24. Параметр a в модели парной регрессии может быть найден как:

- А) $a = (\tilde{x} - b\tilde{y})$;
- Б) $a = (b\tilde{x} - \tilde{y})$;
- В) $a = (\tilde{y} - b\tilde{x})$;
- Г) $a = (b\tilde{y} - \tilde{x})$.

25. Сила корреляционной связи между двумя переменными в генеральной совокупности измеряется при помощи коэффициента корреляции, который изменяется в пределах:

- А) от 0 до +1;
- Б) от -1 до 0;
- В) от -1 до +1;
- Г) от -1 до +∞.

26. Вывод о значимости параметра уравнения β делается если:

$$\text{А) } |t_{\text{набл.}}| > |t_{\text{крит.}}|; \quad \text{Б) } |t_{\text{набл.}}| < |t_{\text{крит.}}|; \quad \text{В) } |t_{\text{набл.}}| = |t_{\text{крит.}}|; \quad \text{Г) } |t_{\text{набл.}}| \geq |t_{\text{крит.}}|.$$

27. Для проверки значимости коэффициента детерминации используется:

А) хи-квадрат; Б) F -критерий Фишера;) t -критерий Стьюдента.

28. Для получения прогноза \hat{y}_i по уравнению множественной регрессии

необходимо:

А) оценить статистическую значимость параметров уравнения регрессии;

Б) найти средние значения факторных признаков, включенных в уравнение множественной регрессии;

В) подставить в уравнение множественной регрессии значения x_{ji} .

29. Скорректированный коэффициент детерминации в модели множественной регрессии находят как:

$$\text{А) } VIF(x_h) = \frac{1}{1 - R_h^2}; \quad \text{Б) } SR_i = \frac{e_i}{S_{yx} \sqrt{1 - h_i}}; \quad \text{В) } \bar{R}_{yx_1, x_2}^2 = 1 - (1 - R_{yx_1, x_2}^2) \frac{n-1}{n-m-1}.$$

30. Автокорреляция – это:

А) замена данных, имеющих отношение к мелким временным периодам, данными по более крупным периодам;

Б) выравнивание уровней ряда по аналитическим формулам;

В) зависимость между последовательными (соседними) уровнями временного ряда.

31. Источниками ошибок ε являются (выберите несколько правильных ответов) :

А) неучтенные факторы;

Б) недетерминированность индивидуального поведения;

В) ошибки измерения;

Г) детерминированный характер зависимости.

32. Наиболее распространенными в эконометрическом моделировании являются следующие классы моделей (выберите несколько правильных ответов) :

А) регрессионные модели с одним уравнением; Б) модели временных рядов;

В) системы одновременных уравнений; Г) Logit – модели.

33. Относительно формы регрессии различают (выберите несколько правильных ответов) :

А) линейную регрессию;

Б) нелинейную регрессию;

В) множественную регрессию; Г) простую регрессию.

34. Метод Наименьших Квадратов используется для :

- А) нахождения параметров регрессии;
- Б) интерпретации параметров регрессии;
- В) определения формы регрессионной зависимости.

35. Стандартная ошибка оценки уравнения регрессии может быть рассчитана как:

$$\text{А) } S_{yx} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \hat{x}_i)^2}{n-2}}; \quad \text{Б) } S_{yx} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{n-2}}; \quad \text{В) } S_{yx} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \tilde{y}_i)^2}{n-2}}.$$

36. Выборочный коэффициент корреляции (R) связан с коэффициентом детерминации (R^2) следующим образом:

$$\text{А) } R = \sqrt{R^2 \cdot R^2}; \quad \text{Б) } R = \frac{1}{R^2}; \quad \text{В) } R = (R^2)^2; \quad \text{Г) } R = \sqrt{R^2}.$$

37. Для проверки значимости параметра уравнения β необходимо рассчитать:

$$\text{А) } \chi_{набл.}^2 = \sum \frac{(f_0 - f_E - 0,5)^2}{f_E}; \quad \text{Б) } t_{n-2} = \frac{b - \beta}{S_b}; \quad \text{В) } F_{набл.} = \frac{R^2}{(1 - R^2)/(n - 2)}.$$

38. Явление мультиколлинеарности состоит в следующем:

- А) две или более независимых переменных, включенных в уравнение множественной регрессии, связаны между собой линейной корреляционной зависимостью;
- Б) две или более независимых переменных и зависимая переменная связаны между собой линейной корреляционной зависимостью;
- В) правильного ответа нет

39. Гетероскедастичность случайных остатков означает, что:

- А) остатки модели e_i имеют непостоянную дисперсию;
- Б) распределение остатков e_i является нормальным;
- В) остатки e_i носят случайный характер.

40. Модель временного ряда с аддитивной компонентой выглядит как:

$$\text{А) Фактическое значение} = \text{Трендовое значение} + \text{Сезонная вариация} + \text{Ошибка} \quad (A = T + S + E);$$

- Б) Фактическое значение = Трендовое значение · Сезонная вариация · Ошибка ($A = T \cdot S \cdot E$);
 В) Фактическое значение = Трендовое значение + Сезонная вариация · Ошибка ($A = T + S \cdot E$).

42. Модель временного ряда с мультипликативной компонентой выглядит как:

- А) Фактическое значение = Трендовое значение + Сезонная вариация + Ошибка ($A = T + S + E$);
 Б) Фактическое значение = Трендовое значение · Сезонная вариация · Ошибка
 ($A = T \cdot S \cdot E$);
 В) Фактическое значение = Трендовое значение + Сезонная вариация ·
 Ошибка ($A = T + S \cdot E$).

Критерии оценки тестовых заданий:

Тестовые задания (ТЗ) выполняются студентами ДФО перед контрольной точкой текущей аттестации соответственно по разделам, студентами ЗФО – без разбивки по разделам.

Максимальное количество баллов по разделу – 2.

Оценка 2 балла выставляется обучающемуся, если он правильно ответил на 80% и более тестовых заданий;

Оценка 1 балл выставляется обучающемуся, если он правильно ответил на 40 -79% тестовых заданий;

Оценка 0 баллов выставляется обучающемуся, если он правильно ответил на 40 % и менее тестовых заданий.

2.2.3 Комплекс индивидуальных заданий для самостоятельной работы студента (ИЗСРС) для оценивания результатов обучения в виде знаний:

Задания для самостоятельной работы

“Парная регрессия и корреляция”.

Задача 1

Введем следующие обозначения:

X - факторный признак, независимая (объясняющая) переменная,

Y - результативный признак, зависимая переменная,

x – фактические значения факторного признака,

y – фактические значения результативного признака,

\hat{y} - расчетные (полученные по уравнению регрессии) значения результативного признака,

a, b - параметры уравнения регрессии.

В контрольных заданиях используется уравнение парной линейной регрессии вида:

$$Y = \alpha + \beta X + \xi$$

Рассмотрим методику выполнения на условиях конкретной задачи:

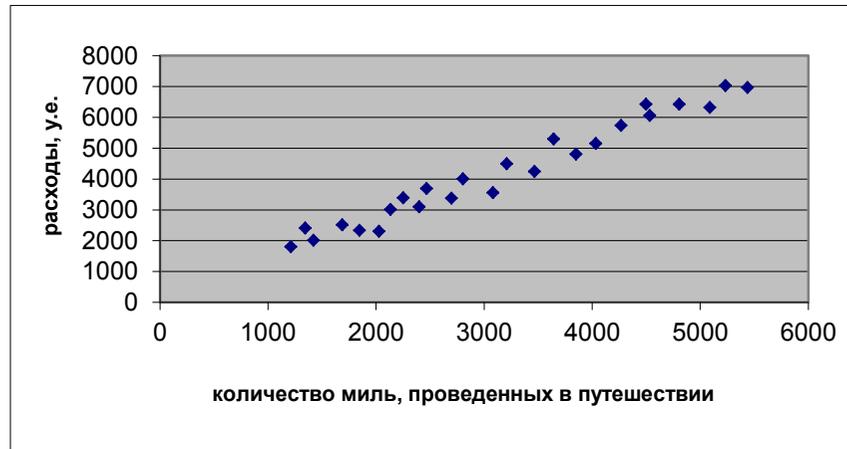
American Express Company в течение долгого времени полагала, что владельцы ее кредитных карт предпочитают оплачивать свои расходы во время путешествий при помощи их карт. Для выяснения этого из компьютерной базы компании были случайно выбраны 25 владельцев карточек, которым были заданы вопросы о числе миль, которые они провели в путешествиях. Данные опроса о расходах путешественников и числе миль, проведенных ими в пути, составляют исходную информацию задачи.

<i>N</i> <i>n/n</i>	<i>Число миль,</i> <i>проведенных в</i> <i>пути, X</i>	<i>Расходы, у.е., Y</i>	<i>N</i> <i>n/n</i>	<i>Число миль,</i> <i>проведенных в</i> <i>пути, X</i>	<i>Расходы, у.е., Y</i>
1	1211	1802	14	3209	4492
2	1345	2405	15	3466	4244
3	1422	2005	16	3643	5298
4	1687	2511	17	3852	4801
5	1847	2332	18	4033	5147
6	2026	2305	19	4267	5738
7	2133	3016	20	4498	6420
8	2253	3385	21	4533	6059
9	2400	3090	22	4804	6426
10	2468	3694	23	5090	6321
11	2699	3371	24	5233	7025
12	2806	3998	25	5439	6964
13	3082	3555			

Пункт 1. Построение поля корреляции результата и фактора производится по исходным данным о парах значений факторного и результативного признаков с соблюдением масштаба. На основе поля корреляции делаются выводы о направлении и возможной

функциональной форме связи между факторным и результативным признаками (прямая - обратная, линейная - нелинейная).

Для условий рассматриваемой задачи поле корреляции выглядит следующим образом:
Связь между факторным и результативным признаками прямая, линейная.



Пункт 2. Оценка параметров уравнения парной линейной регрессии производится обычным методом наименьших квадратов (МНК):

$$\hat{y}_i = a + bx_i, \text{ где}$$

a и b – оценки параметров модели.

Величины, минимизирующие суммы квадратов отклонений y от \hat{y} для случая парной линейной регрессии, находятся как:

$$b = \frac{\sum_{i=1}^n [(x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})]}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2};$$

$$a = (\bar{y} - b\bar{x}).$$

Значения ошибок, называемые обычно остатками, рассчитываются как $e_i = (y_i - \hat{y}_i)$.

Проведите интерпретацию полученных результатов.

Расчет необходимых данных лучше всего организовать в таблице. Для нашего примера таблица будет выглядеть следующим образом:

Таблица 1

N/N	x	y	$x_i - \bar{x}$	$y_i - \bar{y}$	$(x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})$	$(x_i - \bar{x})^2$	\hat{y}_i	$e_i = \hat{y}_i - y_i$
1	1211	1802	-1966,84	-2454,16	4826940	3868460	1787,652	14,34756
2	1345	2405	-1832,84	-1851,16	3392880	3359302	1955,831	449,1692
3	1422	2005	-1755,84	-2251,16	3952677	3082974	2052,471	-47,4707
4	1687	2511	-1490,84	-1745,16	2601754	2222604	2385,062	125,9377
5	1847	2332	-1330,84	-1924,16	2560749	1771135	2585,872	-253,872
6	2026	2305	-1151,84	-1951,16	2247424	1326735	2810,529	-505,529
7	2133	3016	-1044,84	-1240,16	1295769	1091691	2944,82	71,17973
8	2253	3385	-924,84	-871,16	805683,6	855329	3095,428	289,5722
9	2400	3090	-777,84	-1166,16	907085,9	605035,1	3279,922	-189,922
10	2468	3694	-709,84	-562,16	399043,7	503872,8	3365,266	328,7337
11	2699	3371	-478,84	-885,16	423850	229287,7	3655,186	-284,186
12	2806	3998	-371,84	-258,16	95994,21	138265	3789,477	208,5225
13	3082	3555	-95,84	-701,16	67199,17	9185,306	4135,875	-580,875

Продолжение таблицы 1

N/N	x	y	$x_i - \bar{x}$	$y_i - \bar{y}$	$(x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})$	$(x_i - \bar{x})^2$	\hat{y}_i	$e_i = \hat{y}_i - y_i$
14	3209	4492	31,16	235,84	7348,774	970,9456	4295,268	196,7322
15	3466	4244	288,16	-12,16	-3504,03	83036,19	4617,819	-373,819
16	3643	5298	465,16	1041,84	484622,3	216373,8	4839,965	458,035
17	3852	4801	674,16	544,84	367309,3	454491,7	5102,273	-301,273

18	4033	5147	855,16	890,84	761810,7	731298,6	5329,439	-182,439
19	4267	5738	1089,16	1481,84	1613961	1186270	5623,124	114,8759
20	4498	6420	1320,16	2163,84	2856615	1742822	5913,044	506,9564
21	4533	6059	1355,16	1802,84	2443137	1836459	5956,971	102,0292
22	4804	6426	1626,16	2169,84	3528507	2644396	6297,093	128,9072
23	5090	6321	1912,16	2064,84	3948304	3656356	6656,041	-335,041
24	5233	7025	2055,16	2768,84	5690409	4223683	6835,515	189,4853
25	5439	6964	2261,16	2707,84	6122859	5112845	7094,058	-130,058
сумма	79446	106404			51398430	40952877	106404	0
Средн	3177,84	4256,16						

В соответствии с расчетами, представленными в таблице 1, $a = 267,7715$; $b = 1,2551$

Соответственно уравнение регрессии может быть записано как:

$$\hat{y} = 267,7715 + 1,2551x$$

Коэффициент регрессии линейной функции (b) есть абсолютный показатель силы связи, характеризующий среднее абсолютное изменение результата при изменении факторного признака на единицу своего измерения.

Полученное уравнение может быть объяснено следующим образом: с увеличением расстояния на 1 милю расходы путешественника в среднем увеличиваются на 1,2551 условных денежных единиц. Свободный член уравнения равен 267,7715, что может трактоваться как влияние на величину расходов других, неучтенных в модели факторов.

Пункт 3. Линейный коэффициент корреляции характеризует тесноту линейной связи между изучаемыми признаками. Его можно определить по следующей формуле:

$$r = \frac{\sum (x - \bar{x})(y - \bar{y})}{n\sigma_x\sigma_y}$$

Значения линейного коэффициента корреляции принадлежит промежутку $[-1;1]$.

Чем ближе его абсолютное значение к 1, тем теснее связь между признаками. Положительная величина свидетельствует о прямой связи

между изучаемыми признаками, отрицательная - о наличии обратной связи между признаками.

Для нашей задачи $r=0,98329$, что подтверждает вывод, сделанный в пункте 1, что связь между признаками прямая, а также указывает на очень сильную взаимосвязь между количеством миль, проведенных в пути и расходами.

Квадрат коэффициента (индекса) корреляции называется коэффициентом детерминации и показывает долю вариации результативного признака, объясненную вариацией факторного признака.

Чаще всего, давая интерпретацию коэффициента детерминации, его выражают в процентах. Например: $R^2=0,8$ означает, что доля колеблемости результативного признака, объясненная вариацией фактора X , включенного в уравнение регрессии, равна 80%. Остальные 20% приходятся на долю прочих факторов, не учтенных в уравнении регрессии.

Для нашей задачи коэффициент детерминации равен 0,9669, то есть 96,69% вариации результативного признака (расходов путешественников) объясняется вариацией факторного признака (количеством миль, проведенных в пути)

Пункт 4 связан с темой “Проверка статистических гипотез”. Рекомендуется использовать следующую общую процедуру проверки гипотез:

1. Сформулируйте нулевую гипотезу о том, что коэффициент регрессии статистически незначим: $H_0 : \beta = 0$ (линейной зависимости нет) при конкурирующей: $H_1 : \beta \neq 0$ (линейная зависимость есть)

или о том, что уравнение в целом статистически незначимо: $H_0 : R^2 = 0$.

2. Определите фактическое значение соответствующего критерия.

3. Сравните полученное фактическое значение с табличным.

4. Если фактическое значение используемого критерия превышает табличное, нулевая гипотеза отклоняется, и с вероятностью $(1-\alpha)$ принимается альтернативная гипотеза о статистической значимости коэффициента регрессии. Если фактическое значение t - критерия меньше табличного, оснований отклонять нулевую гипотезу - нет.

Статистическая значимость коэффициента регрессии β проверяется с помощью t - критерия Стьюдента:

$$t_{n-2} = \frac{b - \beta}{S_b},$$

где

$$S_b = \frac{S_{yx}}{\sqrt{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2}} = \frac{S_{yx}}{\sqrt{\sum_{i=1}^n x_i^2 - \frac{(\sum_{i=1}^n x)^2}{n}}},$$

S_{yx} - стандартная ошибка оценки, рассчитываемая по формуле

$$S_{yx} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2}{n-2}}.$$

Так как нулевая гипотеза предполагает, что $\beta=0$, то $t_{набл.}$ рассчитывается как:

$$t_{набл.} = \frac{b-0}{S_b}.$$

Для определения табличного значения воспользуйтесь таблицами распределения Стьюдента для заданного уровня значимости α , принимая во внимание, что число степеней свободы для распределения Стьюдента равно $(k = n - 2)$.

Для нашего примера $t_{набл.} = 25,906$, а $t_{табл.(\alpha=0,05,k=23)} = 2,07$, следовательно нулевая гипотеза отвергается в пользу альтернативной и коэффициент регрессии β статистически значим, то есть наличие существенной линейной зависимости между количеством миль, проведенных в путешествии и величиной расходов статистически подтверждается.

Оценка статистической значимости построенной модели регрессии в целом производится с помощью F- критерия Фишера. Фактическое значение F-критерия качества оценивания регрессии, который представляет собой отношение объясненной суммы квадратов SSR (в расчете на одну независимую переменную) к остаточной сумме квадратов SSE (в расчете на одну степень свободы), определяется как:

$$F_{набл.} = \frac{\frac{SSR}{k}}{\frac{SSE}{n-k-1}},$$

где $SSR = \sum_{i=1}^n (\hat{y}_i - \bar{y})^2$ - факторная, или объясненная моделью регрессии, сумма квадратов,

$SSE = \sum_{i=1}^n (y_i - \hat{y}_i)^2$ - остаточная, или необъясненная моделью сумма квадратов

k - число независимых переменных.

F - критерий можно выразить через коэффициент детерминации:

$$F_{набл.} = \frac{R^2}{(1 - R^2)/(n - 2)}.$$

Для определения табличного значения воспользуйтесь таблицами распределения Фишера-Снедекора для заданного уровня значимости α , принимая во внимание, что в случае парной регрессии число степеней свободы большей дисперсии равно 1, а число степеней свободы меньшей дисперсии равно $n - 2$.

Для нашего примера $F_{набл.} = 671,137$, а $F_{табл.(\alpha=0,05, k_1=1, k_2=23)} = 4,45$. Так как $F_{набл.} \gg F_{табл.}$ построенная модель регрессии в целом значима и может в дальнейшем использоваться нами для прогнозов.

Для выполнения **пункта 5** необходимо изучить вопрос об интервальном оценивании в регрессионном анализе, уяснить смысл понятий “точечный прогноз” и “интервальный прогноз”. Для расчета точечного прогноза \hat{Y}_k подставьте в уравнение регрессии заданное значение факторного признака X^* .

Так, например, если необходимо оценить расходы путешественника, преодолевшего (собирающегося преодолеть) 4500 миль, следует использовать уравнение регрессии записанное нами в пункте 2:

$\hat{y} = 267,7715 + 1,2551 \cdot 4500 = 5915,7215$, то есть в среднем путешественник, преодолевший 4500 миль израсходует 5915,7215 условных денежных единиц.

Доверительный интервал для значений \hat{y}_i , лежащих на линии регрессии, имеет вид:

$$\hat{y}_i \pm t_{n-2} S_{yx} \sqrt{1 + h_i},$$

где

$$h_i = \frac{1}{n} + \frac{(x^* - \bar{x})^2}{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2} = \frac{1}{n} + \frac{(x^* - \bar{x})^2}{\sum_{i=1}^n x_i^2 - \frac{(\sum_{i=1}^n x_i)^2}{n}}$$

\hat{y}_i - прогнозное значение зависимой переменной;

S_{yx} - стандартная ошибка оценки;

n - объем выборки;

x^* - заданное значение X .

Полученный интервал будет характеризовать значения результативного признака при заданном значении факторного признака x^* для отдельной наблюдаемой единицы.

Так, для нашего примера этот доверительный интервал будет выглядеть как $5247,8367 < \hat{y}_i < 6582,9665$, то есть с вероятностью 0,95 можно утверждать, что расходы **одного** путешественника, преодолевшего 4500 миль составят от 5247,8367 до 6582,9665 условных денежных единиц.

Если же необходимо сделать вывод об интервале значений результативного признака для всех наблюдаемых единиц при среднем значении факторного признака x^* , расчет будет производиться по формуле доверительного интервала генерального значения $\hat{y}_{ген.}$:

$$\hat{y}_i \pm t_{n-2} S_{yx} \sqrt{h_i}.$$

В соответствии с условиями рассматриваемого примера доверительный интервал, характеризующий расходы всех путешественников, преодолевших 4500 миль будет выглядеть как $5730,918 < \hat{y}_{ген.} < 6099,885$, то есть расходы **всех** путешественников, преодолевших расстояние в 4500 миль составят от 5730,918 до 6099,885 условных денежных единиц.

Задача 2

Задания:

- 1) Определите парные и частные коэффициенты корреляции, проверьте их значимость на уровне значимости $\alpha = 0,05$, сделайте выводы.
- 2) Постройте линейное уравнение множественной регрессии и поясните экономический смысл его параметров. Проверьте значимость параметров уравнения регрессии на уровне значимости $\alpha = 0,05$.
- 3) Рассчитайте коэффициенты эластичности. Дайте их интерпретацию.
- 4) Найдите множественные коэффициенты корреляции и детерминации, объясните их смысл.

5) Проверьте значимость полученного уравнения регрессии в целом на уровне значимости $\alpha = 0,05$, сделайте выводы.

1. В конце семестра студенты сдают экзамены. Перед сдачей экзаменов в 20 группах был проведен опрос о том, какую оценку по сдаваемым в сессию курсам они ожидают получить. После сессии полученные оценки были сопоставлены с ожидаемыми и числом студентов в группах.

Средняя оценка по предмету в i-той группе студентов	Ожидаемая оценка	Число студентов в группе
4,1	3,4	45
3,4	3,1	52
3,3	3,0	47
3,0	2,8	63
4,7	3,7	20
4,6	3,5	32
3,0	2,9	51
4,6	3,7	32
4,6	3,5	21
3,6	3,2	33
3,5	3,0	40
4,0	3,5	29
3,6	3,3	38
3,1	3,1	67
3,3	3,3	61
4,5	3,9	50
2,8	2,9	63
3,7	3,2	47
3,8	3,4	51
3,9	3,4	31

2. Имеются следующие данные о результатах аукционных торгов старинными часами:

№ п/п	Цена продажи, тыс. у.е.	Возраст часов, лет	Число участников аукционных торгов, чел.	№ п/п	Цена продажи, тыс. у.е.	Возраст часов, лет	Число участников аукционных торгов, чел.
1	1,2	127	13	11	1,7	137	15

2	1,1	115	12	12	1,0	117	11
3	0,8	127	7	13	1,1	137	8
4	1,5	150	9	14	1,1	153	6
5	1,0	156	6	15	1,2	117	13
6	2,0	182	11	16	1,3	126	10
7	1,8	156	12	17	1,5	150	9
8	1,2	132	10	18	0,9	127	7
9	1,3	137	9	19	1,1	115	12
10	0,9	113	9	20	1,2	127	13

3. Имеются следующие данные по 20 предприятиям отрасли промышленности:

№ п/п	Производительность труда, у.е. на 1 рабочего	Энерговооруженность, квт.-ч на 1 рабочего	Доля рабочих, занятых ручным трудом в общей численности рабочих, %
1	9,8	4,8	40
2	6,7	2,8	59
3	12,4	7,0	38
4	6,9	3,8	57
5	11,8	5,5	31
6	7,3	3,0	56
7	8,4	3,4	45
8	10,7	5,2	35
9	11,1	5,4	32
10	7,3	2,9	54
11	8,8	3,9	43
12	10,0	5,0	36
13	12,1	6,2	29
14	11,9	5,1	32
15	6,8	2,7	55
16	7,0	2,9	50
17	12,0	6,1	30
18	7,5	3,3	48
19	8,0	3,4	45

20	9,2	3,8	49
----	-----	-----	----

4. По выборке из 20 почтовых отправлений изучается зависимость стоимости отправки корреспонденции экспресс - почтой от веса конверта и дальности перевозки:

№ п/п	Стоимость доставки, у.е.	Вес конверта, г	Дальность перевозки, тыс. км.	№ п/п	Стоимость доставки, у.е.	Вес конверта, г	Дальность перевозки, тыс. км.
1	26	590	0,5	11	110	510	2,4
2	39	320	1,5	12	50	240	2,1
3	80	44	2,0	13	20	30	1,6
4	92	66	1,6	14	60	620	1,2
5	44	75	2,8	15	11	270	0,4
6	15	70	0,8	16	80	350	2,5
7	145	650	2,4	17	33	410	1,0
8	19	450	0,5	18	121	810	1,6
9	10	60	1,0	19	155	700	2,6
10	140	750	1,9	20	17	110	0,9

5. Имеются следующие данные о ценах и дивидендах по обыкновенным акциям, а также о доходности капитала компании XYZ:

№ п/п	Цена акции, у.е.	Доходность капитала, %	Уровень дивидендов, %	№ п/п	Цена акции, у.е.	Доходность капитала, %	Уровень дивидендов, %
1	25	15,2	2,6	11	25	15,3	2,6
2	20	13,9	2,1	12	26	15,2	2,8
3	15	15,8	1,5	13	26	12,0	2,7
4	34	12,8	3,1	14	20	15,3	1,9
5	20	6,9	2,5	15	20	13,7	1,9
6	33	14,6	3,1	16	13	13,3	1,6
7	28	15,4	2,9	17	21	15,1	2,4
8	30	17,3	2,8	18	31	15,0	3,0
9	23	13,7	2,4	19	26	11,2	3,1
10	24	12,7	2,4	20	11	12,1	2,0

6. Для анализа эффективности работы предприятий машиностроения были получены следующие данные:

№ п/п	Рентабельность, прибыль в % к стоимости основных и оборотных фондов	Производительность труда, у.е. на 1 работника	Средний возраст производственного оборудования, лет.
1	7	7	20
2	8	10	19
3	7	9	21
4	9	11	17
5	9	11	16
6	8	11	18
7	11	13	15
8	11	14	14
9	16	17	10
10	15	18	11
11	19	21	9
12	16	18	11
13	18	20	10
14	17	20	10
15	19	22	9
16	20	23	8
17	11	12	15
18	11	11	14
19	10	12	13
20	15	17	12

7. Изучается влияние изменения объема промышленного производства и среднедушевого дохода на товарооборот. Для этого по 20 регионам РФ были получены следующие данные:

№ п/п	Розничный товарооборот (в % к предыдущему году)	Объем промышленного производства (в % к предыдущему году)	Среднедушевой денежный доход (в % к предыдущему году)
1	89	85	88
2	75	70	85

3	82	86	81
4	84	80	87
5	91	97	87
6	92	79	110
7	89	92	102
8	107	99	105
9	89	83	94
10	87	77	92
11	96	88	82
12	75	89	85
13	74	72	84
14	86	80	105
15	73	81	94
16	100	97	98
17	87	73	92
18	87	75	95
19	98	84	101
20	81	75	88

8. По 25 предприятиям отрасли имеются данные об объеме производства, потреблении сырья и электроэнергии:

№ предприятия	Производство продукции, тыс. шт.	Потребление сырья, тыс. т.	Потребление электроэнергии, кВт.ч.
1	24,6	3,2	2,3
2	37,4	4,1	1,7
3	45,4	2,2	0,9
4	46,7	1,6	2,0
5	50,1	4,4	2,7
6	51,3	10,5	3,7
7	55,0	2,6	1,0
8	66,0	5,7	2,0
9	68,3	9,5	2,1
10	70,8	5,0	1,6
11	86,1	2,8	2,0

12	96,9	8,1	2,3
13	99,1	6,0	1,5
14	111,9	6,2	2,8
15	122,6	10,6	4,2
16	166,9	8,3	2,6
17	171,6	6,1	2,2
18	173,8	9,8	3,5
19	177,5	9,6	8,5
20	177,6	13,3	4,2
21	171,2	12,3	4,6
22	213,0	7,7	3,9
23	257,1	13,1	6,5
24	269,3	19,5	5,3
25	359,2	21,5	7,8

9. Имеются следующие данные о посевной площади зерновых культур, валовом сборе и внесении минеральных удобрений на 1 га посевной площади:

№ фермерского хозяйства	Посевная площадь зерновых культур, тыс. га	Валовой сбор, тыс. т.	Внесено минеральных удобрений на 1 га посевной площади, кг.
1	4,0	6,0	30
2	2,0	4,6	33
3	3,1	4,4	20
4	3,2	4,5	25
5	3,4	5,5	29
6	3,5	4,8	20
7	3,7	5,1	21
8	3,2	5,2	20
9	3,9	7,0	35
10	3,5	5,3	30
11	5,0	7,5	35
12	3,7	7,7	30
13	5,0	7,3	40
14	3,8	7,0	42

15	5,0	6,7	39
----	-----	-----	----

10. Имеются данные о бюджетах домохозяйств США, долл. в месяц:

Семья	Доход семьи	Расходы на питание	Расходы на одежду
1	3000	850	250
2	2500	700	150
3	4000	950	250
4	6000	1150	450
5	3300	800	200
6	5300	1000	700
7	4200	900	400
8	6500	1550	1000
9	2800	800	400
10	3650	1200	600
11	5850	1400	950
12	4500	950	350

Задача 3

Задания:

- 1) Определите коэффициент автокорреляции первого порядка и дайте его интерпретацию.
- 2) Обоснуйте выбор вида уравнения тренда и определите его параметры.
- 3) Дайте прогноз уровня ряда на следующий календарный период времени (дату).
- 4) Сделайте выводы.

1. Имеются следующие данные о квартальных объемах реализации нового продукта предприятием оптовой торговли:

Период времени	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Объем реализации, тыс. шт.	14	135	297	498	737	1016	1336	1700	2101

2. Имеются следующие данные о количестве зарегистрированных малых предприятий города:

Месяц	Число зарегистрированных малых предприятий, ед.
Январь	222
Февраль	322
Март	427
Апрель	530
Май	631
Июнь	731
Июль	832
Август	927
Сентябрь	1010

3. Имеются следующие данные о средней урожайности зерновых в области:

Годы	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Урожайность зерновых (ц/га)	8,8	9,0	9,7	10,7	12,2	14,2	16,6	19,6	22,9

4. Имеются поквартальные данные о численности занятых на предприятиях машиностроения в некотором городе:

№ квартала	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Численность занятых (тыс. чел.)	232	220	209	197	187	175	164	155	146

5. Имеются следующие данные о базисных темпах роста среднедушевого дохода населения области за 10 месяцев (в % к январю):

Месяц	Темпы роста среднедушевого дохода (%)
Февраль	102
Март	103
Апрель	107
Май	114
Июнь	118
Июль	126
Август	134
Сентябрь	146
Октябрь	156
Ноябрь	166

6. Имеются следующие данные об уровне безработицы в регионе:

Месяц	Уровень безработицы, %
Январь	8,9
Февраль	8,6
Март	8,4
Апрель	8,1
Май	7,9
Июнь	7,6
Июль	7,3
Август	7,2
Сентябрь	7,0

7. Имеются данные о поголовье крупного рогатого скота в районе:

Год	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997
Поголовье крупного рогатого скота, тыс. голов	63,0	67,2	70,0	71,3	73,2	74,1	75,0

8. Имеются следующие данные о производстве продукции предприятия за 1992-1997 гг. (в сопоставимых ценах), млн. у.е.:

Год	1992	1993	1994	1995	1996	1997
Объем производства, у.е.	80	84	89	95	101	108

9. Добыча угля в Восточно-Сибирском районе характеризуется следующими данными, млн т:

Год	1991	1992	1993	1994	1995
Добыча угля, млн. т	103	97	85	76	72

10. Имеются следующие данные о динамике числа профессиональных театров в РФ:

Год	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996
Число профессиональных театров на конец года	382	393	421	439	460	470	489

Задача 4

Задания:

- 1) Определите функциональную форму трендовых уравнений регрессии для изучаемых признаков и рассчитайте их параметры.
- 2) Найдите линейный коэффициент корреляции между изучаемыми признаками:
 - а) по исходным уровням ряда;
 - б) по первым разностям уровней рядов;
 - в) по отклонениям от тренда.
- 3) Сделайте вывод о степени тесноты связи между изучаемыми признаками.
- 4) Определите параметры уравнения парной линейной регрессии по первым разностям и поясните их смысл.

1. Имеются следующие данные о динамике среднегодовой численности промышленно-производственного персонала и индекса физического объема продукции в промышленности Ростовской области в 1990-1995 гг.

	1990	1991	1992	1993	1994	1995
Среднегодовая численность ППП, тыс. чел.	519,3	500,4	472,6	446,9	412,4	369,3
Индекс физического объема продукции, в % к 1990 г.	100	99,0	87,8	68,5	45,1	38,7

2. Имеются следующие данные о динамике числа браков и родившихся в Ростовской области в 1990-1998 гг.

1. Год	2. Количество браков, тыс.	3. Количество родившихся, тыс.
4. 1990	5. 39,6	6. 54,0
7. 1991	8. 39,7	9. 51,0
10. 1992	11. 31,5	12. 47,0
13. 1993	14. 34,9	15. 41,6
16. 1994	17. 34,5	18. 42,5
19. 1995	20. 35,5	21. 40,7
22. 1996	23. 25,6	24. 38,8
25. 1997	26. 27,8	27. 36,7
28. 1998	29. 24,5	30. 36,2

3. Изучается взаимосвязь между уровнем инфляции и вкладами населения в коммерческие банки. Ниже приводятся данные по одному из иностранных коммерческих банков за 9 лет:

Время, лет	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Индекс цен (в % к	128	110	109	115	100	90	95	87	80

предыдущему году)									
Депозиты физических лиц (млн. дол., в сопоставимых ценах)	4,2	4,6	4,7	4,1	5,0	5,5	5,3	6,0	6,5

4. Для анализа зависимости между изменением цен на молоко и молокопродукты и потреблением белка населением города было проведено выборочное обследование и получены следующие данные за 10 месяцев:

Месяц	Потребление белка в среднем за месяц в расчете на душу населения (г)	Индекс цен на молоко и молокопродукты (в % к январю)
Январь	2000	100
Февраль	2010	108
Март	2022	115
Апрель	2040	118
Май	2057	122
Июнь	2075	126
Июль	2092	132
Август	2108	139
Сентябрь	2128	143
Октябрь	2150	145

5. Администрация компании XYZ проводит анализ кадровой политики. В частности, требуется определить, зависит ли общий объем продаж от удельного веса женщин среди работников компании. Были получены следующие данные за последние 9 кварталов:

Номер квартала	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Объем продаж компании, тыс. у.е.	378	385	393	403	414	428	444	462	481
Удельный вес женщин в общем числе работников компании, %	25	24	27	30	31	29	31	33	34

6. Исследуется зависимость объема продаж бензина от динамики потребительских цен. Были получены следующие данные за последние 9 кварталов:

Квартал	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Индекс потребительских цен (в % к кварталу 9)	139	132	126	121	117	112	106	100	100

Средний за день объем продаж бензина в течение квартала (тыс. л.)	65	68	72	75	77	80	83	85	89
---	----	----	----	----	----	----	----	----	----

7. Имеются следующие данные о динамике средней ожидаемой продолжительности предстоящей жизни при рождении и национального дохода на душу населения в США в 1971 – 1985 гг.:

Годы	Средняя ожидаемая продолжительность предстоящей жизни при рождении, лет	Национальный доход на душу населения, долл.
1971	71,1	4304,4
1972	71,2	4841,2
1973	71,4	5362,9
1974	72,0	5669,0
1975	72,6	5968,8
1976	72,9	6617,9
1977	73,3	7329,1
1978	73,5	8233,1
1979	73,9	9097,5
1980	73,7	9674,7
1981	74,2	10617,5
1982	74,5	10830,9
1983	74,6	11582,2
1984	74,7	12778,8
1985	74,7	13498,2

8. Имеются следующие данные о динамике располагаемого личного дохода и расходов на питание на душу населения в США в 1971 – 1985 гг.:

Годы	Располагаемый личный доход, долл.	Расходы на питание, долл.
1971	779,2	130,0
1972	810,3	132,4
1973	865,3	129,4
1974	858,4	128,1
1975	875,8	132,3
1976	906,8	139,7

1977	942,9	145,2
1978	988,8	146,1
1979	1015,5	149,3
1980	1021,6	153,2
1981	1049,3	153,0
1982	1058,3	154,6
1983	1095,4	161,2

9. Ниже приводятся данные об уровне дивидендов, выплачиваемых по обыкновенным акциям, и среднегодовой стоимости основных фондов (ОФ) компании X в сопоставимых ценах:

Период времени	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Среднегодовая стоимость ОФ (тыс. у.е.)	72	75	77	77	79	80	78	79	80
Дивиденд по обыкновенным акциям, %	4,2	3,0	2,4	2,0	1,9	1,7	1,8	1,6	1,7

10. Изучается зависимость между объемом инвестиций в основные производственные фонды (ОПФ) и валовой добавленной стоимостью (ВДС). Ниже представлены данные по некоторой отрасли промышленности за последние 10 лет:

(в сопоставимых ценах, млн. у.е.)

Время, лет	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Объем инвестиций в ОПФ	140	160	190	210	220	240	260	290	310	320
ВДС	300	345	405	445	480	535	595	639	677	704

Задача 5

Задания:

- 1) Постройте график ряда динамики.
- 2) Оцените характер сезонных колебаний и сделать выбор между моделью с сезонной и мультипликативной компонентой.
- 3) Проведите сглаживание ряда динамики с помощью скользящей средней.
- 4) Найдите значения десезонализированных данных и нанесите их на график.

- 5) В предположении существования линейного тренда постройте модель с аддитивной или мультипликативной компонентой.
 6) Рассчитайте ошибку, среднее абсолютное отклонение (MAD) и среднеквадратическую ошибку (MSE) модели.
 7) Сделайте прогноз на ближайшие три календарных периода времени. Прокомментируйте вопрос о вероятной точности ваших прогнозов.

1. В таблице представлены данные по двухмесячному объему производства среднего предприятия обрабатывающей отрасли промышленности, расположенного в Дублине:

Период	Объем производства, тонн			
	1995	1996	1997	1998
Январь-февраль	120	119	110	107
Март-апрель	132	125	119	114
Май-июнь	106	99	102	92
Июль-август	98	98	89	88
Сентябрь-октябрь	88	86	79	75
Ноябрь-декабрь	94	90	88	80

2. В таблице приведены данные по средней заявленной годовой арендной плате за съем деловых помещений в центральной части Лондона в период 1993 - 1997 гг.:

Год	Годовая плата за аренду помещения, у.е. за кв. м.		
	Январь-апрель	Май-август	Сентябрь-декабрь
1993	120	100	121
1994	138	120	142
1995	160	138	163
1996	184	162	182
1997	208	175	206

3. Ниже приведены квартальные объемы продукции компании «Cobournes plc»:

Год	1				2				3		
Квартал	1	2	3	4	1	2	3	4	1	2	3
Объем выпуска, тыс. у.е.	24	50	56	63	79	89	79	80	93	100	88

4. Ниже приводятся скорректированные на инфляцию данные о прибыли компании «Doble-Flood» за последние 10 кварталов:

Год	1				2				3	
Квартал	1	2	3	4	1	2	3	4	1	2
Прибыль, тыс. у.е.	146	106	123	89	97	74	80	53	56	35

5. Объемы выпуска продукции компании «Banham and Barsey» приведены в таблице:

Год	1			2				3		
Квартал	2	3	4	1	2	3	4	1	2	3
Объем выпуска, тыс. у.е.	400	715	600	585	560	975	800	765	720	1235

6. В таблице приведены данные по объему продаж компании АПИ в странах Восточной Европы в период 1994 - 1997 гг.:

Год	Объем продаж мазута, тыс. баррелей		
	Январь-апрель	Май-август	Сентябрь-декабрь
1994	35	15	42
1995	36	19	44
1996	41	22	47
1997	45	26	52

7. Динамика товарооборота компании «Amada plc» за последние 11 кварталов, скорректированного на инфляцию, представлена в таблице:

Год	1				2				3		
Квартал	1	2	3	4	1	2	3	4	1	2	3
Товарооборот, тыс. у.е.	22	28	34	27	31	43	43	41	46	53	56

8. Динамика квартального спроса на стулья компании «Peace Retailers» представлена в таблице:

Год	1		2				3			
Квартал	3	4	1	2	3	4	1	2	3	4
Спрос, тыс. штук	157	137	156	151	153	141	154	152	154	142

9. В таблице приведены данные по общей стоимости экспортных заказов некой компании в период 1993 - 1996 гг.:

Год	Общий объем экспорта, млн. у.е.		
	Январь-апрель	Май-август	Сентябрь-декабрь
1994	4,5	5,6	4,9
1995	5,1	5,9	5,2
1996	5,4	6,8	5,8
1997	6,0	6,8	6,1

10. В таблице приведены данные по общему объему продаж газеты одного из канадских издательств в период 1994 - 1997 гг.:

Период	Дневной объем продаж газеты, тыс. экз.			
	1994 г.	1995 г.	1996 г.	1997 г.
I квартал	2,2	2,6	2,9	3,2
II квартал	2,9	3,2	3,4	3,6
III квартал	3,3	3,6	3,9	4,2
IV квартал	2,4	2,7	2,8	3,1

Задание 1.

Для данных варианта, предложенного преподавателем, выполните следующее:

- 1) Постройте поле корреляции результативного и факторного признаков.
- 2) Определите параметры уравнения парной линейной регрессии и дайте интерпретацию коэффициента регрессии b .
- 3) Рассчитайте линейный коэффициент корреляции и поясните его смысл. Определите коэффициент детерминации и дайте его интерпретацию.
- 4) С вероятностью 0,95 оцените статистическую значимость коэффициента регрессии b и уравнения регрессии в целом. Сделайте выводы.
- 5) С вероятностью 0,95 постройте доверительный интервал для прогноза оценки \hat{y}_p и доверительный интервал генерального значения $\hat{y}_{ген}$ (x_p задается отдельно в условиях каждой задачи).

Таблица 1
Варианты заданий

Номера	вариантов	Номер	признаков	из	Номер
--------	-----------	-------	-----------	----	-------

заданий		Приложения	наблюдений
1:21	11:31	1:2	1 ÷ 25 (для вариантов 1 ÷ 10 и 21 ÷ 30)
2:22	12:32	1:3	
3:23	13:33	1:4	
4:24	14:34	1:5	
5:25	15:35	2:3	
6:26	16:36	2:4	
7:27	17:37	2:5	
8:28	18:38	3:4	26 ÷ 50 (для вариантов 11 ÷ 20; 31 ÷ 40)
9:29	19:39	3:5	
10:30	20:40	4:5	

Показатели деятельности производственных предприятий за 2005г.

Номер наблюдения	Курсовая цена акции предприятия, тыс.руб	Дивиденды, начисленные по результатам деятельности, млрд.руб	Дебиторская задолженность на конец года, млрд.руб	Балансовая прибыль, млрд.руб	Собственные оборотные средства, млрд.руб
	1	2	3	4	5
1	20	17	7	80	320
2	50	20	5	105	611
3	80	19	1	100	840
4	35	17	7	94	482
5	115	20	2	112	1050
6	40	19	5	108	499
7	40	17	4	100	505
8	50	19	4	88	521
9	30	17	7	92	412
10	35	17	7	90	405
11	70	19	2	92	788
12	120	21	1	101	1280
13	100	20	2	98	990
14	70	19	7	95	810
15	65	19	5	90	750
16	80	19	2	95	924
17	150	21	1	109	1950
18	50	18	5	90	590
19	60	20	3	97	722
20	50	19	5	90	540
21	60	19	5	87	700
22	40	20	5	100	980
23	40	19	6	98	490
24	25	20	5	89	375
25	85	18	3	90	910
26	75	19	4	97	845
27	175	21	4	108	2400
28	100	20	2	102	1100
29	40	18	7	88	470
30	50	18	6	96	588
31	75	19	3	92	860
32	25	18	5	102	395
33	95	21	2	115	1000
34	60	19	6	90	640
35	70	18	3	92	805
36	85	20	2	95	920
37	170	21	1	108	2125
38	120	21	3	95	1400
39	160	21	1	99	1850
40	50	19	3	97	770
41	80	20	2	102	905
42	20	18	7	95	355
43	55	19	5	90	610

44	70	20	6	101	697
45	80	20	2	104	900
46	100	21	1	120	1025
47	60	20	6	101	697
48	50	18	2	95	570
49	70	19	4	98	800
50	160	21	1	108	2100

Задача 2

Задания:

- 1) Определите парные и частные коэффициенты корреляции, проверьте их значимость на уровне значимости $\alpha = 0,05$, сделайте выводы.
- 2) Постройте линейное уравнение множественной регрессии и поясните экономический смысл его параметров. Проверьте значимость параметров уравнения регрессии на уровне значимости $\alpha = 0,05$.
- 3) Рассчитайте коэффициенты эластичности. Дайте их интерпретацию.
- 4) Найдите множественные коэффициенты корреляции и детерминации, объясните их смысл.
- 5) Проверьте значимость полученного уравнения регрессии в целом на уровне значимости $\alpha = 0,05$, сделайте выводы.

1. В конце семестра студенты сдают экзамены. Перед сдачей экзаменов в 20 группах был проведен опрос о том, какую оценку по сдаваемым в сессию курсам они ожидают получить. После сессии полученные оценки были сопоставлены с ожидаемыми и числом студентов в группах.

Средняя оценка по предмету в i -той группе студентов	Ожидаемая оценка	Число студентов в группе
4,1	3,4	45
3,4	3,1	52
3,3	3,0	47
3,0	2,8	63
4,7	3,7	20
4,6	3,5	32
3,0	2,9	51
4,6	3,7	32
4,6	3,5	21
3,6	3,2	33
3,5	3,0	40
4,0	3,5	29
3,6	3,3	38
3,1	3,1	67
3,3	3,3	61
4,5	3,9	50
2,8	2,9	63
3,7	3,2	47
3,8	3,4	51

3,9	3,4	31
-----	-----	----

2. Имеются следующие данные о результатах аукционных торгов старинными часами:

№ п/п	Цена продажи, тыс. у.е.	Возраст т часов, лет	Число участников аукционных торгов, чел.	№ п/п	Цена продажи, тыс. у.е.	Возраст т часов, лет	Число участников аукционных торгов, чел.
1	1,2	127	13	11	1,7	137	15
2	1,1	115	12	12	1,0	117	11
3	0,8	127	7	13	1,1	137	8
4	1,5	150	9	14	1,1	153	6
5	1,0	156	6	15	1,2	117	13
6	2,0	182	11	16	1,3	126	10
7	1,8	156	12	17	1,5	150	9
8	1,2	132	10	18	0,9	127	7
9	1,3	137	9	19	1,1	115	12
10	0,9	113	9	20	1,2	127	13

3. Имеются следующие данные по 20 предприятиям отрасли промышленности:

№ п/п	Производительность труда, у.е. на 1 рабочего	Энерговооруженность, квт.-ч на 1 рабочего	Доля рабочих, занятых ручным трудом в общей численности рабочих, %
1	9,8	4,8	40
2	6,7	2,8	59
3	12,4	7,0	38
4	6,9	3,8	57
5	11,8	5,5	31
6	7,3	3,0	56
7	8,4	3,4	45
8	10,7	5,2	35
9	11,1	5,4	32
10	7,3	2,9	54
11	8,8	3,9	43
12	10,0	5,0	36
13	12,1	6,2	29
14	11,9	5,1	32
15	6,8	2,7	55
16	7,0	2,9	50
17	12,0	6,1	30
18	7,5	3,3	48
19	8,0	3,4	45
20	9,2	3,8	49

4. По выборке из 20 почтовых отправок изучается зависимость стоимости отправки корреспонденции экспресс - почтой от веса конверта и дальности перевозки:

№ п/п	Стоимость доставки, у.е.	Вес конверта, г	Дальность перевозки, тыс. км.	№ п/п	Стоимость доставки, у.е.	Вес конверта, г	Дальность перевозки, тыс. км.
1	26	590	0,5	11	110	510	2,4
2	39	320	1,5	12	50	240	2,1
3	80	44	2,0	13	20	30	1,6
4	92	66	1,6	14	60	620	1,2
5	44	75	2,8	15	11	270	0,4
6	15	70	0,8	16	80	350	2,5
7	145	650	2,4	17	33	410	1,0
8	19	450	0,5	18	121	810	1,6
9	10	60	1,0	19	155	700	2,6
10	140	750	1,9	20	17	110	0,9

5. Имеются следующие данные о ценах и дивидендах по обыкновенным акциям, а также о доходности капитала компании XYZ:

№ п/п	Цена акции, у.е.	Доходность капитала, %	Уровень дивидендов, %	№ п/п	Цена акции, у.е.	Доходность капитала, %	Уровень дивидендов, %
1	25	15,2	2,6	11	25	15,3	2,6
2	20	13,9	2,1	12	26	15,2	2,8
3	15	15,8	1,5	13	26	12,0	2,7
4	34	12,8	3,1	14	20	15,3	1,9
5	20	6,9	2,5	15	20	13,7	1,9
6	33	14,6	3,1	16	13	13,3	1,6
7	28	15,4	2,9	17	21	15,1	2,4
8	30	17,3	2,8	18	31	15,0	3,0
9	23	13,7	2,4	19	26	11,2	3,1
10	24	12,7	2,4	20	11	12,1	2,0

6. Для анализа эффективности работы предприятий машиностроения были получены следующие данные:

№ п/п	Рентабельность, прибыль в % к стоимости основных и оборотных фондов	Производительность труда, у.е. на 1 работника	Средний возраст производственного оборудования, лет.
1	7	7	20
2	8	10	19
3	7	9	21
4	9	11	17
5	9	11	16
6	8	11	18
7	11	13	15
8	11	14	14
9	16	17	10

10	15	18	11
11	19	21	9
12	16	18	11
13	18	20	10
14	17	20	10
15	19	22	9
16	20	23	8
17	11	12	15
18	11	11	14
19	10	12	13
20	15	17	12

7. Изучается влияние изменения объема промышленного производства и среднедушевого дохода на товарооборот. Для этого по 20 регионам РФ были получены следующие данные:

№ п/п	Розничный товарооборот (в % к предыдущему году)	Объем промышленного производства (в % к предыдущему году)	Среднедушевой денежный доход (в % к предыдущему году)
1	89	85	88
2	75	70	85
3	82	86	81
4	84	80	87
5	91	97	87
6	92	79	110
7	89	92	102
8	107	99	105
9	89	83	94
10	87	77	92
11	96	88	82
12	75	89	85
13	74	72	84
14	86	80	105
15	73	81	94
16	100	97	98
17	87	73	92
18	87	75	95
19	98	84	101
20	81	75	88

8. По 25 предприятиям отрасли имеются данные об объеме производства, потреблении сырья и электроэнергии:

№ предприятия	Производство продукции, тыс. шт.	Потребление сырья, тыс. т.	Потребление электроэнергии, кВт.ч.
1	24,6	3,2	2,3
2	37,4	4,1	1,7

3	45,4	2,2	0,9
4	46,7	1,6	2,0
5	50,1	4,4	2,7
6	51,3	10,5	3,7
7	55,0	2,6	1,0
8	66,0	5,7	2,0
9	68,3	9,5	2,1
10	70,8	5,0	1,6
11	86,1	2,8	2,0
12	96,9	8,1	2,3
13	99,1	6,0	1,5
14	111,9	6,2	2,8
15	122,6	10,6	4,2
16	166,9	8,3	2,6
17	171,6	6,1	2,2
18	173,8	9,8	3,5
19	177,5	9,6	8,5
20	177,6	13,3	4,2
21	171,2	12,3	4,6
22	213,0	7,7	3,9
23	257,1	13,1	6,5
24	269,3	19,5	5,3
25	359,2	21,5	7,8

9. Имеются следующие данные о посевной площади зерновых культур, валовом сборе и внесении минеральных удобрений на 1 га посевной площади:

№ фермерского хозяйства	Посевная площадь зерновых культур, тыс. га	Валовой сбор, тыс. т.	Внесено минеральных удобрений на 1 га посевной площади, кг.
1	4,0	6,0	30
2	2,0	4,6	33
3	3,1	4,4	20
4	3,2	4,5	25
5	3,4	5,5	29
6	3,5	4,8	20
7	3,7	5,1	21
8	3,2	5,2	20
9	3,9	7,0	35
10	3,5	5,3	30
11	5,0	7,5	35
12	3,7	7,7	30
13	5,0	7,3	40
14	3,8	7,0	42
15	5,0	6,7	39

10. Имеются данные о бюджетах домохозяйств США, долл. в месяц:

Семья	Доход семьи	Расходы на питание	Расходы на одежду
1	3000	850	250
2	2500	700	150
3	4000	950	250
4	6000	1150	450
5	3300	800	200
6	5300	1000	700
7	4200	900	400
8	6500	1550	1000
9	2800	800	400
10	3650	1200	600
11	5850	1400	950
12	4500	950	350

Задача 3

Задания:

- 1) Определите коэффициент автокорреляции первого порядка и дайте его интерпретацию.
- 2) Обоснуйте выбор вида уравнения тренда и определите его параметры.
- 3) Дайте прогноз уровня ряда на следующий календарный период времени (дату).
- 4) Сделайте выводы.

1. Имеются следующие данные о квартальных объемах реализации нового продукта предприятием оптовой торговли:

Период времени	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Объем реализации, тыс. шт.	14	135	297	498	737	1016	1336	1700	2101

2. Имеются следующие данные о количестве зарегистрированных малых предприятий города:

Месяц	Число зарегистрированных малых предприятий, ед.
Январь	222
Февраль	322
Март	427
Апрель	530
Май	631
Июнь	731
Июль	832
Август	927
Сентябрь	1010

3. Имеются следующие данные о средней урожайности зерновых в области:

Годы	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Урожайность зерновых (ц/га)	8,8	9,0	9,7	10,7	12,2	14,2	16,6	19,6	22,9

4. Имеются поквартальные данные о численности занятых на предприятиях машиностроения в некотором городе:

№ квартала	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Численность занятых (тыс. чел.)	232	220	209	197	187	175	164	155	146

5. Имеются следующие данные о базисных темпах роста среднедушевого дохода населения области за 10 месяцев (в % к январю):

Месяц	Темпы роста среднедушевого дохода (%)
Февраль	102
Март	103
Апрель	107
Май	114
Июнь	118
Июль	126
Август	134
Сентябрь	146
Октябрь	156
Ноябрь	166

6. Имеются следующие данные об уровне безработицы в регионе:

Месяц	Уровень безработицы, %
Январь	8,9
Февраль	8,6
Март	8,4
Апрель	8,1
Май	7,9
Июнь	7,6
Июль	7,3
Август	7,2
Сентябрь	7,0

7. Имеются данные о поголовье крупного рогатого скота в районе:

Год	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997
Поголовье крупного рогатого скота, тыс. голов	63,0	67,2	70,0	71,3	73,2	74,1	75,0

8. Имеются следующие данные о производстве продукции предприятия за 1992-1997 гг. (в сопоставимых ценах), млн. у.е.:

Год	1992	1993	1994	1995	1996	1997
Объем производства, у.е.	80	84	89	95	101	108

9. Добыча угля в Восточно-Сибирском районе характеризуется следующими данными, млн т:

Год	1991	1992	1993	1994	1995

Добыча угля, млн. т	103	97	85	76	72
---------------------	-----	----	----	----	----

10. Имеются следующие данные о динамике числа профессиональных театров в РФ:

Год	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996
Число профессиональных театров на конец года	382	393	421	439	460	470	489

Задача 4

Задания:

- 1) Определите функциональную форму трендовых уравнений регрессии для изучаемых признаков и рассчитайте их параметры.
- 2) Найдите линейный коэффициент корреляции между изучаемыми признаками:
 - а) по исходным уровням ряда;
 - б) по первым разностям уровней рядов;
 - в) по отклонениям от тренда.
- 3) Сделайте вывод о степени тесноты связи между изучаемыми признаками.
- 4) Определите параметры уравнения парной линейной регрессии по первым разностям и поясните их смысл.

1. Имеются следующие данные о динамике среднегодовой численности промышленно-производственного персонала и индекса физического объема продукции в промышленности Ростовской области в 1990-1995 гг.

	1990	1991	1992	1993	1994	1995
Среднегодовая численность ППП, тыс. чел.	519,3	500,4	472,6	446,9	412,4	369,3
Индекс физического объема продукции, в % к 1990 г.	100	99,0	87,8	68,5	45,1	38,7

2. Имеются следующие данные о динамике числа браков и родившихся в Ростовской области в 1990-1998 гг.

31. Год	32. Количество браков, тыс.	33. Количество родившихся, тыс.
34. 1990	35. 39,6	36. 54,0
37. 1991	38. 39,7	39. 51,0
40. 1992	41. 31,5	42. 47,0
43. 1993	44. 34,9	45. 41,6
46. 1994	47. 34,5	48. 42,5
49. 1995	50. 35,5	51. 40,7
52. 1996	53. 25,6	54. 38,8
55. 1997	56. 27,8	57. 36,7
58. 1998	59. 24,5	60. 36,2

3. Изучается взаимосвязь между уровнем инфляции и вкладами населения в коммерческие банки. Ниже приводятся данные по одному из иностранных коммерческих банков за 9 лет:

Время, лет	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Индекс цен (в % к предыдущему году)	128	110	109	115	100	90	95	87	80

Депозиты физических лиц (млн. дол., в сопоставимых ценах)	4,2	4,6	4,7	4,1	5,0	5,5	5,3	6,0	6,5
--	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

4. Для анализа зависимости между изменением цен на молоко и молокопродукты и потреблением белка населением города было проведено выборочное обследование и получены следующие данные за 10 месяцев:

Месяц	Потребление белка в среднем за месяц в расчете на душу населения (г)	Индекс цен на молоко и молокопродукты (в % к январю)
Январь	2000	100
Февраль	2010	108
Март	2022	115
Апрель	2040	118
Май	2057	122
Июнь	2075	126
Июль	2092	132
Август	2108	139
Сентябрь	2128	143
Октябрь	2150	145

5. Администрация компании XYZ проводит анализ кадровой политики. В частности, требуется определить, зависит ли общий объем продаж от удельного веса женщин среди работников компании. Были получены следующие данные за последние 9 кварталов:

Номер квартала	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Объем продаж компании, тыс. у.е.	378	385	393	403	414	428	444	462	481
Удельный вес женщин в общем числе работников компании, %	25	24	27	30	31	29	31	33	34

6. Исследуется зависимость объема продаж бензина от динамики потребительских цен. Были получены следующие данные за последние 9 кварталов:

Квартал	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Индекс потребительских цен (в % к кварталу 9)	139	132	126	121	117	112	106	100	100
Средний за день объем продаж бензина в течение квартала (тыс. л.)	65	68	72	75	77	80	83	85	89

7. Имеются следующие данные о динамике средней ожидаемой продолжительности предстоящей жизни при рождении и национального дохода на душу населения в США в 1971 – 1985 гг.:

Годы	Средняя ожидаемая продолжительность предстоящей жизни при рождении, лет	Национальный доход на душу населения, долл.
1971	71,1	4304,4
1972	71,2	4841,2
1973	71,4	5362,9

1974	72,0	5669,0
1975	72,6	5968,8
1976	72,9	6617,9
1977	73,3	7329,1
1978	73,5	8233,1
1979	73,9	9097,5
1980	73,7	9674,7
1981	74,2	10617,5
1982	74,5	10830,9
1983	74,6	11582,2
1984	74,7	12778,8
1985	74,7	13498,2

8. Имеются следующие данные о динамике располагаемого личного дохода и расходов на питание на душу населения в США в 1971 – 1985 гг.:

Годы	Располагаемый личный доход, долл.	Расходы на питание, долл.
1971	779,2	130,0
1972	810,3	132,4
1973	865,3	129,4
1974	858,4	128,1
1975	875,8	132,3
1976	906,8	139,7
1977	942,9	145,2
1978	988,8	146,1
1979	1015,5	149,3
1980	1021,6	153,2
1981	1049,3	153,0
1982	1058,3	154,6
1983	1095,4	161,2

9. Ниже приводятся данные об уровне дивидендов, выплачиваемых по обыкновенным акциям, и среднегодовой стоимости основных фондов (ОФ) компании X в сопоставимых ценах:

Период времени	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Среднегодовая стоимость ОФ (тыс.у.е.)	72	75	77	77	79	80	78	79	80
Дивиденд по обыкновенным акциям, %	4,2	3,0	2,4	2,0	1,9	1,7	1,8	1,6	1,7

10. Изучается зависимость между объемом инвестиций в основные производственные фонды (ОПФ) и валовой добавленной стоимостью (ВДС). Ниже представлены данные по некоторой отрасли промышленности за последние 10 лет:

(в сопоставимых ценах, млн. у.е.)

Время, лет	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
Объем инвестиций в ОПФ	140	160	190	210	220	240	260	290	310	320

ВДС	300	345	405	445	480	535	595	639	677	704
-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

Задача 5

Задания:

- 1) Постройте график ряда динамики.
- 2) Оцените характер сезонных колебаний и сделать выбор между моделью с сезонной и мультипликативной компонентой.
- 3) Проведите сглаживание ряда динамики с помощью скользящей средней.
- 4) Найдите значения десезонализированных данных и нанесите их на график.
- 5) В предположении существования линейного тренда постройте модель с аддитивной или мультипликативной компонентой.
- 6) Рассчитайте ошибку, среднее абсолютное отклонение (MAD) и среднеквадратическую ошибку (MSE) модели.
- 7) Сделайте прогноз на ближайшие три календарных периода времени. Прокомментируйте вопрос о вероятной точности ваших прогнозов.

1. В таблице представлены данные по двухмесячному объему производства среднего предприятия обрабатывающей отрасли промышленности, расположенного в Дублине:

Период	Объем производства, тонн			
	1995	1996	1997	1998
Январь-февраль	120	119	110	107
Март-апрель	132	125	119	114
Май-июнь	106	99	102	92
Июль-август	98	98	89	88
Сентябрь-октябрь	88	86	79	75
Ноябрь-декабрь	94	90	88	80

2. В таблице приведены данные по средней заявленной годовой арендной плате за съем деловых помещений в центральной части Лондона в период 1993 - 1997 гг.:

Год	Годовая плата за аренду помещения, у.е. за кв. м.		
	Январь-апрель	Май-август	Сентябрь-декабрь
1993	120	100	121
1994	138	120	142
1995	160	138	163
1996	184	162	182
1997	208	175	206

3. Ниже приведены квартальные объемы продукции компании «Cobournes plc»:

Год	1				2				3		
	1	2	3	4	1	2	3	4	1	2	3
Объем выпуска, тыс. у.е.	24	50	56	63	79	89	79	80	93	100	88

4. Ниже приводятся скорректированные на инфляцию данные о прибыли компании «Doble-Flood» за последние 10 кварталов:

Год	1				2				3	
Квартал	1	2	3	4	1	2	3	4	1	2
Прибыль, тыс. у.е.	146	106	123	89	97	74	80	53	56	35

5. Объемы выпуска продукции компании «Banham and Barsey» приведены в таблице:

Год	1			2				3		
Квартал	2	3	4	1	2	3	4	1	2	3
Объем выпуска, тыс. у.е.	400	715	600	585	560	975	800	765	720	1235

6. В таблице приведены данные по объему продаж компании АПИ в странах Восточной Европы в период 1994 - 1997 гг.:

Год	Объем продаж мазута, тыс. баррелей								
	Январь-апрель			Май-август				Сентябрь-декабрь	
1994	35			15				42	
1995	36			19				44	
1996	41			22				47	
1997	45			26				52	

7. Динамика товарооборота компании «Amada plc» за последние 11 кварталов, скорректированного на инфляцию, представлена в таблице:

Год	1				2				3		
Квартал	1	2	3	4	1	2	3	4	1	2	3
Товарооборот, тыс. у.е.	22	28	34	27	31	43	43	41	46	53	56

8. Динамика квартального спроса на стулья компании «Peace Retailers» представлена в таблице:

Год	1				2				3			
Квартал	3	4	1	2	3	4	1	2	3	4		
Спрос, тыс. штук	157	137	156	151	153	141	154	152	154	142		

9. В таблице приведены данные по общей стоимости экспортных заказов некой компании в период 1993 - 1996 гг.:

Год	Общий объем экспорта, млн. у.е.								
	Январь-апрель			Май-август				Сентябрь-декабрь	
1994	4,5			5,6				4,9	
1995	5,1			5,9				5,2	
1996	5,4			6,8				5,8	
1997	6,0			6,8				6,1	

10. В таблице приведены данные по общему объему продаж газеты одного из канадских издательств в период 1994 - 1997 гг.:

Период	Дневной объем продаж газеты, тыс. экз.			
	1994 г.	1995 г.	1996 г.	1997 г.
I квартал	2,2	2,6	2,9	3,2

II квартал	2,9	3,2	3,4	3,6
III квартал	3,3	3,6	3,9	4,2
IV квартал	2,4	2,7	2,8	3,1

Критерии оценки индивидуальных заданий (ИЗСРС):

Индивидуальные задания для самостоятельной работы студентов (ИЗСРС) выполняются студентами ДФО в течении семестра по темам. Каждый студент имеет номер варианта, который определяется по списку в журнале. Преподаватель проверяет выполненные варианты и перед контрольной точкой текущей аттестации выставляет оценочный балл. Студентам ЗФО предлагается выполнять задания во время изучения дисциплины.

Максимальное количество баллов по разделу – 6.

Оценка 5-6 баллов выставляется обучающемуся, если он правильно выполнил все задания;

Оценка 3-4 балла выставляется обучающемуся, если он правильно выполнил все задания после второй проверки преподавателем;

Оценка 1-2 балла выставляется обучающемуся, если он правильно выполнил задания после второй и более проверок преподавателем.

Оценка 0 баллов выставляется обучающемуся, если он не выполнял индивидуальные задания.

2.3 Типовые экзаменационные материалы

Перечень вопросов для проведения зачета (теоретические вопросы)

Перечень вопросов к зачету.

1. Классификация эконометрических моделей. Основные этапы построения эконометрических моделей.
2. Специфика экономических данных. Зависимые и независимые переменные.
3. Структура и особенности временных рядов экономических показателей.
4. Типы экономических данных, используемых в эконометрических исследованиях: пространственные данные и временные ряды.
5. Требования, предъявляемые к информационной базе временных рядов.
6. Методы выявления тенденций во временных рядах.
7. Методы обнаружения и устранения аномальных наблюдений во временных рядах.
8. Исследование и моделирование тренд сезонных, сезонных и периодических колебаний в функционировании финансовых рынков.
9. Экстраполяционные методы и модели прогнозирования социально-экономических процессов.
10. Критерии точности и адекватности экономико-математических моделей.
11. Экстраполяция тенденций развития финансово-экономических показателей с использованием кривых роста. Точечные и интервальные прогнозы.
12. Линейная модель парной регрессии. Оценка параметров модели с помощью метода наименьших квадратов (МНК).
13. Матричная форма метода наименьших квадратов. Экономический смысл коэффициентов модели.
14. Оценка существенности параметров линейной регрессии. Интервалы прогноза по линейному уравнению регрессии.
15. Нелинейная регрессия. Нелинейные модели и их линеаризация.
16. Кривые Энгеля. Эконометрический подход к оцениванию неизвестных параметров однофакторных функции спроса и производственных функций.
17. Оценка параметров множественной регрессии методом наименьших квадратов (МНК). Свойства оценок МНК.

18. Методы отбора факторов при построении множественной регрессии.
19. Мультиколлинеарность. Способы её обнаружения, методы её устранения.
20. Корреляционная матрица. Отбор факторов на основе корреляционного анализа.
21. Отбор факторов при построении множественной регрессии. Процедура пошагового отбора переменных.
22. Коэффициенты множественной корреляции и детерминации, критерий Фишера, критерий Стьюдента.
23. Показатели качества регрессии.
24. Регрессионные модели с переменной структурой (фиктивные переменные). Нелинейные модели множественной регрессии. Функция Кобба-Дугласа, ее основные характеристики.
25. Анализ экономических объектов и прогнозирование с помощью модели множественной регрессии.

**Перечень практических заданий для проведения зачета
(практический вопрос)**

Вариант 1	Вариант 2																																				
<p>По однородным предприятиям (i – номер предприятия) имеются данные о количестве рабочих с профессиональной подготовкой (x, %) и количестве бракованной продукции (y, %):</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr><td>i</td><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td></tr> <tr><td>x</td><td>39,4</td><td>40,1</td><td>48,6</td><td>54,7</td><td>58,4</td></tr> <tr><td>y</td><td>17,1</td><td>18,3</td><td>11,2</td><td>9,3</td><td>10,8</td></tr> </table> <ol style="list-style-type: none"> 1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. 2. Рассчитайте параметры линейной регрессии. Оцените тесноту связи с помощью показателей корреляции и детерминации. 3. Дайте с помощью среднего (общего) коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом. 4. Оцените с помощью средней ошибки аппроксимации качество уравнения. 	i	1	2	3	4	5	x	39,4	40,1	48,6	54,7	58,4	y	17,1	18,3	11,2	9,3	10,8	<p>Компания «Вест», состоящая из 5 региональных представительств (i – номер представительства), продает кухонные принадлежности, рассылая каталоги по почте. Данные, иллюстрирующие количество рассылок (x, тыс. адресов) и объем выручки региональных представительств компании (y, млн у.е.):</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr><td>i</td><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td></tr> <tr><td>x</td><td>65</td><td>55</td><td>67</td><td>41</td><td>59</td></tr> <tr><td>y</td><td>28</td><td>19</td><td>20</td><td>17,5</td><td>20</td></tr> </table> <ol style="list-style-type: none"> 1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. 2. Рассчитайте параметры линейной регрессии. Оцените тесноту связи с помощью показателей корреляции и детерминации. 3. Дайте с помощью среднего (общего) коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом. 4. Оцените с помощью средней 	i	1	2	3	4	5	x	65	55	67	41	59	y	28	19	20	17,5	20
i	1	2	3	4	5																																
x	39,4	40,1	48,6	54,7	58,4																																
y	17,1	18,3	11,2	9,3	10,8																																
i	1	2	3	4	5																																
x	65	55	67	41	59																																
y	28	19	20	17,5	20																																

	ошибки аппроксимации качество уравнения.																																				
<p style="text-align: center;">Вариант 3</p> <p>По территориям некоторых регионов (i – номер региона) известны данные за год по среднедневной заработной плате (y, руб.) и среднедушевому прожиточному минимуму в день одного трудоспособного (x, руб.):</p> <table border="1" data-bbox="279 1081 711 1189"> <tr><td>i</td><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td></tr> <tr><td>x</td><td>95</td><td>107</td><td>125</td><td>111</td><td>89</td></tr> <tr><td>y</td><td>162</td><td>151</td><td>190</td><td>178</td><td>161</td></tr> </table> <ol style="list-style-type: none"> 1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. 2. Рассчитайте параметры линейной регрессии. Оцените тесноту связи с помощью показателей корреляции и детерминации. 3. Дайте с помощью среднего (общего) коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом. 4. Оцените с помощью средней ошибки аппроксимации качество уравнения 	i	1	2	3	4	5	x	95	107	125	111	89	y	162	151	190	178	161	<p style="text-align: center;">Вариант 4</p> <p>Имеются данные о цене однокомнатной квартиры и величине ее общей площади по 5 сделкам одного района города:</p> <table border="1" data-bbox="975 958 1299 1066"> <tr><td>i</td><td>1</td><td>2</td><td>3</td><td>4</td><td>5</td></tr> <tr><td>x</td><td>35</td><td>35</td><td>33</td><td>34</td><td>38</td></tr> <tr><td>y</td><td>29</td><td>31</td><td>35</td><td>35</td><td>45</td></tr> </table> <ol style="list-style-type: none"> 1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи. 2. Рассчитайте параметры линейной регрессии. Оцените тесноту связи с помощью показателей корреляции и детерминации. 3. Дайте с помощью среднего (общего) коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи фактора с результатом. 4. Оцените с помощью средней ошибки аппроксимации качество уравнения 	i	1	2	3	4	5	x	35	35	33	34	38	y	29	31	35	35	45
i	1	2	3	4	5																																
x	95	107	125	111	89																																
y	162	151	190	178	161																																
i	1	2	3	4	5																																
x	35	35	33	34	38																																
y	29	31	35	35	45																																

Методика формирования оценки и критерии оценивания промежуточной аттестации (зачет с оценкой): максимальное количество баллов при полном раскрытии вопросов и верном решении практической задачи билета:

1 Теоретический вопрос -30 баллов;

2 Практическое задание или задача -20 баллов;

Итого: зачет (с оценкой) – 50 баллов.

Структура оценочных материалов (оценочных средств), позволяющих оценить уровень компетенций, сформированный у обучающихся при изучении дисциплины «*Эконометрика*» приведен в таблице 4.

Таблица 4 - Оценочные материалы (оценочные средства) по дисциплине «Эконометрика»

Код компетенции	Знать	Оценочные средства		Уметь	Оценочные средства		Владеть	Оценочные средства	
		текущий контроль	промежуточный контроль		текущий контроль	промежуточный контроль		текущий контроль	промежуточный контроль
ОПК-2	основы регрессионного анализа; основы статистического оценивания и анализа точности параметров уравнения регрессии; основы анализа и прогнозирования временных рядов.	УО: 1-5, 16-25, 31-35 ТЗ 1-10, ИЗСРС: 1-10 (свой вариант)	Вопросы к зачету, примеры к зачету	пользоваться методами первичной обработки и анализа наблюдаемых данных; решать типовые задачи в пределах изучаемого программного материала; оценивать и давать прогноз полученным результатам.	УО 9,10, 12, 31, 32. ТЗ 1-10, ИЗСР С: 1-10 (свой вариант)	Вопросы к зачету, примеры к зачету	методами обработки и анализа наблюдаемых данных; методами решения основных эконометрических уравнений; пониманием исторических предпосылок эконометрики, область применения и степень применимости;	УО 1-10, 17-22, 30. ТЗ 1-10, ИЗСР С: 1-10 (свой вариант)	Вопросы к зачету, примеры к зачету

ПК-1	основные положения, теоретические основы и прикладные методики для решения основных эконометрических уравнений; основы анализа эконометрических моделей, представляющих собой системы одновременных уравнений; основы анализа и прогнозирования временных рядов.	УО: 27-35 ТЗ 1-10, ИЗСРС: 1-10 (свой вариант)	Вопросы к зачету Примеры к зачету	Использовать основные предпосылки, необходимые для правильного применения классических регрессионных моделей; Использовать информационные системы поддержки эконометрических исследований и расчётов; самостоятельно работать с учебно-методической литературой и электронными учебно-методическими комплексами.	УО: 28,30-33 ИЗСРС: С: 1-10 (свой вариант)	Вопросы к зачету Примеры к зачету	владеть математическим, статистическим аппаратом; терминологией и её прикладной интерпретацией; владеть навыками использования пакетов прикладного программного обеспечения эконометрической направленности; пониманием изучаемого материала.	УО: 30-35 ТЗ 1-10, ИЗСРС: С: 1-10 (свой вариант)	Вопросы к зачету Примеры к зачету
------	--	---	--	--	--	--	---	--	--

