



МИНИСТЕРСТВО СЕЛЬСКОГО ХОЗЯЙСТВА
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
«Казанский государственный аграрный университет»
(ФГБОУ ВО Казанский ГАУ)

Составитель: Газетдинов Ш.М., к.э.н., доцент

Фонд оценочных средств обсужден и одобрен на заседании кафедры экономики и информационных технологий «28» апреля 2020 года (протокол № 13)

Зав. кафедрой, д.э.н., профессор  Газетдинов М.Х.

Институт экономики

Кафедра экономики и информационных технологий



ПРИТВЕРЖДАЮ

проректор
по учебно-методической
работе, проф.
Зиганшин
И.А.
«12» мая 2020 г.

Рассмотрен и одобрен на заседании методической комиссии Института экономики «12» мая 2020 г. (протокол № 11)

Пред. метод. комиссии, к.э.н., доцент  Гатина Ф.Ф.

Согласовано:
Директор Института экономики, к.э.н., доцент  Низамутдинов М.М.

Протокол ученого совета Института экономики № 9 от «12» мая 2020 г.

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ
для проведения промежуточной аттестации обучающихся
по дисциплине
«Эконометрика»
(приложение к рабочей программе дисциплины)

Направление подготовки
38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) подготовки
«Информационные системы и технологии в экономике»

Уровень
бакалавриата

Форма обучения
очная, заочная

Год поступления обучающихся: 2020

Казань – 2020

1. ПЕРЕЧЕНЬ КОМПЕТЕНЦИЙ С УКАЗАНИЕМ ЭТАПОВ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ В ПРОЦЕССЕ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

В результате освоения ОПОП бакалавриата по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, обучающийся должен овладеть следующими результатами обучения по дисциплине «Эконометрика»:

Таблица 1.1 – Требования к результатам освоения дисциплины

| Код компетенции | Этапы освоения компетенции | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине |
|-----------------|----------------------------|--|
| ОПК-3 | 1, 2 этап | <p>1. Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. <p>2. Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - применять инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - применять методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - использовать методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. <p>3. Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - инструментальными средствами для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - методами анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - методами обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. |
| ПК-4 | 1, 2 этап | <p>1. Знать:</p> <ul style="list-style-type: none"> - экономические процессы и явления на микроуровне - экономические процессы и явления на макроуровне - виды эконометрических моделей; - методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов; - методы анализа результатов применения моделей к анализируемым данным; <p>2. Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> - описывать экономические процессы и явления на макроуровне, описывать экономические процессы и явления на |

| | | |
|--|--|---|
| | | <p>микроуровне строить на основе их описания эконометрические модели;</p> <ul style="list-style-type: none"> - анализировать и содержательно интерпретировать результаты, полученные после построения теоретических и эконометрических моделей. <p>3. Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> - методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью эконометрических моделей; - навыками составления математических моделей для решения экономических задач; - навыками работы с узкоспециализированной литературой - методами и приемами анализа экономических явлений и процессов - современной методикой построения эконометрических моделей. |
|--|--|---|

2. ОПИСАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЕЙ И КРИТЕРИЕВ ОЦЕНИВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ НА РАЗЛИЧНЫХ ЭТАПАХ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ, ОПИСАНИЕ ШКАЛ ОЦЕНИВАНИЯ

Таблица 2.1 – Показатели и критерии определения уровня сформированности компетенций

| Компетенция, этапы освоения компетенции | Планируемые результаты обучения | Критерии и показатели результатов обучения | | | |
|--|---|---|---|--|---|
| | | 2 | 3 | 4 | 5 |
| Способность выбирать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные выводы (1, 2 этап) | 1. Знать: - инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | 1. Знать: - слабо знает инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - не знает методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - не знает методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | 1. Знать: - знает инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - не знает методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - не знает методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | 1. Знать: - знает инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - знает методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - не знает методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | 1. Знать: - знает инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей; - знает методы анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - знает методы обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. |
| | 2. Уметь: - применять | 2. Уметь: - не умеет применять | 2. Уметь: - умеет применять | 2. Уметь: - умеет применять | 2. Уметь: - умеет применять |

| | | | | | |
|---|---|--|--|---|---|
| | соответствии с поставленной задачей; -методами обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | методами анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - не владеет методами обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | методами анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - не владеет методами обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов.. | задачей; - владеет методами анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - не владеет методами обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. | анализа результатов расчетов в соответствии с поставленной задачей; - владеет методами обоснования в соответствии с поставленной задачей полученных результатов и расчетов. |
| Способность на основе описания экономических объектов, процессов и явлений строить эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты (1, 2 этап) | 1. Знать: - экономические процессы и явления на микроуровне - экономические процессы и явления на макроуровне - виды эконометрических моделей; - методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов; - методы анализа результатов применения | 1. Знать: - слабо знает экономические процессы и явления на микроуровне - слабо знает экономические процессы и явления на макроуровне - не знает виды эконометрических моделей; - не знает методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов; | 1. Знать: - знает экономические процессы и явления на микроуровне - знает экономические процессы и явления на макроуровне - слабо знает виды эконометрических моделей; - не знает методы построения эконометрических моделей объектов, явлений и процессов; - не знает методы анализа результатов | 1. Знать: - знает экономические процессы и явления на микроуровне - знает экономические процессы и явления на макроуровне - знает виды эконометрических моделей; - знает методы построения эконометрических моделей; - не знает методы построения эконометрических результатов | 1. Знать: - знает экономические процессы и явления на микроуровне - знает экономические процессы и явления на макроуровне - знает виды эконометрических моделей; - знает методы построения эконометрических результатов |

| | | | | | |
|--|--|--|---|--|--|
| | эконометрических моделей к анализируемым данным. | - не знает методы анализа результатов применения эконометрических моделей к анализируемым данным. | применения эконометрических моделей к анализируемым данным. | моделей объектов, явлений и процессов; - не знает методы анализа результатов применения эконометрических моделей к анализируемым данным. | применения эконометрических моделей к анализируемым данным. |
| | <p>2. Уметь:</p> <p>- описывать экономические процессы и явления на макроуровне, описывать экономические процессы и явления на микроуровне строить на основе их описания эконометрические модели;</p> <p>- анализировать и содержательно интерпретировать результаты, полученные после построения эконометрических и применения моделей.</p> | <p>2. Уметь:</p> <p>-не умеет описывать экономические процессы и явления на макроуровне, описывать экономические процессы и явления на микроуровне строить на основе их описания эконометрические модели;</p> <p>-не умеет анализировать и содержательно интерпретировать результаты, полученные после построения эконометрических и применения моделей.</p> | <p>2. Уметь:</p> <p>- умеет описывать экономические процессы и явления на макроуровне, описывать экономические процессы и явления на микроуровне строить на основе их описания эконометрические модели;</p> <p>- не умеет анализировать и содержательно интерпретировать результаты, полученные после построения эконометрических и применения моделей.</p> | <p>2. Уметь:</p> <p>- умеет описывать экономические процессы и явления на макроуровне, описывать экономические процессы и явления на микроуровне строить на основе их описания эконометрические модели;</p> <p>- четко умеет анализировать и содержательно интерпретировать результаты, полученные после построения и применения</p> | <p>2. Уметь:</p> <p>- умеет описывать экономические процессы и явления на макроуровне, описывать экономические процессы и явления на микроуровне строить на основе их описания эконометрические модели;</p> <p>- четко умеет анализировать и содержательно интерпретировать результаты, полученные после построения и применения</p> |

| | | | | | |
|--|--|---|--|---|---|
| | | | | эконометрических моделей. | |
| | <p><i>3. Владеть:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью эконометрических моделей; - навыками составления математических моделей для решения экономических задач; - навыками работы с узкоспециализированной литературой; - современной методикой построения эконометрических моделей. | <p><i>3. Владеть:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - не владеет методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью эконометрических моделей; - не владеет навыками составления математических моделей для решения экономических задач; - слабо владеет навыками работы с узкоспециализированной литературой; - не владеет современной методикой построения эконометрических моделей. | <p><i>3. Владеть:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - владеет методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью эконометрических моделей; - не владеет навыками составления математических моделей для решения экономических задач; - не владеет навыками работы с узкоспециализированной литературой; - современной методикой построения эконометрических моделей. | <p><i>3. Владеть:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - владеет методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью эконометрических моделей; - владеет навыками построения эконометрических моделей для решения экономических задач; - владеет навыками работы с узкоспециализированной литературой; - владеет современной методикой построения эконометрических моделей. | <p><i>3. Владеть:</i></p> <ul style="list-style-type: none"> - владеет методами и приемами анализа экономических явлений и процессов с помощью эконометрических моделей; - владеет навыками построения эконометрических моделей для решения экономических задач; - владеет навыками работы с узкоспециализированной литературой; - владеет современной методикой построения эконометрических моделей. |

Описание шкалы оценивания

1. Оценка «неудовлетворительно» ставится студенту, не овладевшему ни одним из элементов компетенции, т.е. обнаружившему существенные пробелы в знании основного программного материала по дисциплине, допустившему принципиальные ошибки при применении теоретических знаний, которые не позволяют ему продолжить обучение или приступить к практической деятельности без дополнительной подготовки по данной дисциплине.

2. Оценка «удовлетворительно» ставится студенту, овладевшему элементами компетенции «знать», т.е. проявившему знания основного программного материала по дисциплине в объеме, необходимом для последующего обучения и предстоящей практической деятельности,

знакомому с основной рекомендованной литературой, допустившему неточности в ответе на экзамене, но в основном обладающему необходимыми знаниями для их устранения при корректировке со стороны экзаменатора.

3. Оценка «хорошо» ставится студенту, овладевшему элементами компетенции «знать» и «уметь», проявившему полное знание программного материала по дисциплине, освоившему основную рекомендованную литературу, обнаружившему стабильный характер знаний и умений и способному к их самостоятельному применению и обновлению в ходе последующего обучения и практической деятельности.

4. Оценка «отлично» ставится студенту, овладевшему элементами компетенции «знать», «уметь» и «владеть», проявившему всесторонние и глубокие знания программного материала по дисциплине, освоившему основную и дополнительную литературу, обнаружившему творческие способности в понимании, изложении и практическом использовании усвоенных знаний.

5. Оценка «зачтено» соответствует критериям оценок от «отлично» до «удовлетворительно».

6. Оценка «не зачтено» соответствует критерию оценки «неудовлетворительно».

3. ТИПОВЫЕ КОНТРОЛЬНЫЕ ЗАДАНИЯ ИЛИ ИНЫЕ МАТЕРИАЛЫ, НЕОБХОДИМЫЕ ДЛЯ ОЦЕНКИ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ В ПРОЦЕССЕ ОСВОЕНИЯ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Контрольные вопросы по дисциплине

1. Предмет, цель и задачи эконометрики.
2. Эконометрическая модель – основа эконометрического моделирования. Классы моделей.
3. Типы данных и виды переменных в эконометрических исследованиях экономических процессов и явлений.
4. Этапы эконометрического моделирования.
5. Случайная величина. Типы случайных величин. Функция распределения и функция плотности вероятностей распределения случайной величины.
6. Числовые характеристики случайных величин (матожидание, дисперсия, среднее квадратическое отклонение) и их свойства.
7. Генеральная и выборочная совокупности.
8. Точечные оценки. Свойства точечных оценок: несмещенность, эффективность, состоятельность.
9. Проверка статистических гипотез.
10. Коэффициенты ковариации и парной корреляции и их свойства. Проверка значимости коэффициента парной корреляции.
11. Модель парной линейной регрессии. Метод наименьших квадратов.
12. Анализ вариации зависимой переменной. Коэффициент детерминации и его физический смысл.
13. Случайные составляющие коэффициентов регрессии.
14. Предпосылки регрессионного анализа (условия Гаусса-Маркова). Теорема Гаусса-Маркова.
15. Расчет стандартных ошибок коэффициентов уравнения парной линейной регрессии.
16. Проверка гипотез относящихся к коэффициентам уравнения парной линейной регрессии.
17. Прогнозирование в регрессионных моделях. Точечный и интервальный прогнозы.
18. Нелинейные регрессии. Нелинейность по объясняющей переменной и ее устранение. Нелинейность по структурным параметрам и ее устранение.
19. Модель множественной линейной регрессии. Вычисление коэффициентов уравнения множественной линейной регрессии методом наименьших квадратов. Экономическая интерпретация коэффициентов.
20. Коэффициент детерминации для уравнения множественной линейной регрессии.
21. Проблема мультиколлинеарности в уравнении множественной линейной регрессии и методы ее устранения.
22. β коэффициент линейной регрессии и его применение.
23. Порционные коэффициенты вариации и их интерпретация.
24. Проверка выполнения условий Гаусса-Маркова.
25. Проверка случайности ряда остатков.
26. Проверка выполнения первого условия Гаусса-Маркова.
27. Проверка выполнения второго условия Гаусса-Маркова.
28. Проверка выполнения третьего условия Гаусса-Маркова по критерию Дарбина-Уотсона.

29. Проверка нормальности распределения ряда остатков.
30. Влияние отсутствия объясняющей переменной в уравнении регрессии, которая там должна присутствовать.
31. Влияние присутствия объясняющей переменной в уравнении регрессии, которой там не должно быть.
32. Спецификация и классификация переменных в уравнениях регрессии.
33. Пошаговый регрессионный анализ.
34. Сущность обобщенного метода наименьших квадратов.
35. Уравнения регрессии с фиктивными переменными.
36. Замещающие переменные, фиктивные переменные, лаговые переменные.
37. Понятие о коэффициенте эластичности и его характеристика.
38. Система одновременных уравнений.
39. Структурная и приведенная формы системы одновременных уравнений.
40. Идентификация уравнений структурной формы.
41. Необходимые и достаточные условия идентифицируемости уравнений структурной формы.
42. Достаточные условия идентифицируемости уравнений структурной формы
43. Косвенный метод наименьших квадратов.
44. Двухшаговый метод наименьших квадратов.
45. Моделирование временных рядов.
46. Основные элементы временного ряда.
47. Моделирование тенденции временного ряда.
48. Моделирование сезонных и циклических колебаний.
49. Изучение взаимосвязей по временным рядам: специфика статистической оценки взаимосвязей двух временных рядов.
50. Методы исключения тенденции, автокорреляция в остатках.
51. Критерий Дарбина-Уотсона для анализа временных рядов.
52. Модели с распределённым лагом.
53. Динамические модели.

Задания для самостоятельной работы

Задача 1

По территориям Волго – Вятского, Центрально – Чернозёмного и Поволжского районов известны данные о потребительских расходах в расчёте на душу населения, о средней заработной плате и выплатах социального характера (табл. 1 и 2).

Таблица 1

Потребительские расходы в расчёте на душу населения, руб.

| Район | | | | | | | | | | |
|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | 302 | 322 | 364 | 596 | 277 | 461 | 408 | 289 | 307 | 416 |
| 2 | 360 | 899 | 336 | 417 | 321 | 524 | 249 | 338 | 290 | 501 |
| 3 | 310 | 330 | 409 | 354 | 573 | 298 | 253 | 287 | 314 | 403 |
| 4 | 415 | 446 | 452 | 526 | 576 | 351 | 580 | 324 | 316 | 208 |
| 5 | 452 | 642 | 367 | 934 | 588 | 624 | 651 | 307 | 341 | 462 |
| 6 | 502 | 542 | 328 | 412 | 497 | 584 | 322 | 304 | 364 | 368 |
| 7 | 355 | 504 | 460 | 525 | 863 | 425 | 899 | 307 | 342 | 399 |
| 8 | 416 | 861 | 380 | 367 | 624 | 277 | 330 | 290 | 310 | 342 |
| 9 | 501 | 707 | 439 | 364 | 584 | 321 | 446 | 314 | 411 | 354 |
| 10 | 403 | 557 | 344 | 336 | 425 | 573 | 642 | 314 | 304 | 558 |

Средняя заработная плата и выплаты социального характера, руб.

| Район | | | | | | | | | | |
|-------|-----|------|-----|------|------|-----|------|------|-----|-----|
| | 0 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 1 | 554 | 486 | 520 | 913 | 603 | 632 | 524 | 615 | 654 | 688 |
| 2 | 560 | 1989 | 539 | 1095 | 439 | 738 | 371 | 727 | 693 | 833 |
| 3 | 542 | 595 | 540 | 606 | 985 | 515 | 453 | 584 | 704 | 577 |
| 4 | 672 | 1550 | 682 | 876 | 735 | 640 | 1006 | 753 | 780 | 584 |
| 5 | 796 | 937 | 537 | 1314 | 760 | 942 | 997 | 707 | 830 | 949 |
| 6 | 777 | 761 | 589 | 593 | 830 | 888 | 486 | 657 | 554 | 888 |
| 7 | 632 | 767 | 626 | 754 | 2093 | 704 | 1989 | 654 | 560 | 831 |
| 8 | 688 | 1720 | 521 | 528 | 942 | 603 | 595 | 693 | 545 | 562 |
| 9 | 833 | 1735 | 626 | 520 | 888 | 439 | 1550 | 1044 | 672 | 665 |
| 10 | 577 | 1052 | 521 | 539 | 704 | 985 | 937 | 780 | 796 | 705 |

Задание:

1. Постройте поле корреляции и сформулируйте гипотезу о форме связи.
2. Рассчитайте параметры уравнений линейной парной регрессии.
3. Оцените тесноту связи с помощью показателей корреляции и детерминации.
4. Дайте с помощью среднего (общего) коэффициента эластичности сравнительную оценку силы связи факторов с результатом.
5. Оцените с помощью средней ошибки аппроксимации качество уравнений.
6. Оцените с помощью F- критерия Фишера статистическую надежность результатов регрессионного моделирования. По значениям характеристик, рассчитанных в пп.4,5 и данном пункте, выберите лучшее уравнение регрессии и дайте его обоснование.
7. Рассчитайте прогнозное значение результата, если прогнозное значение фактора увеличится на 9% от его среднего уровня. Определите доверительный интервал прогноза для уровня значимости $\alpha = 0,05$.
8. Оцените полученные результаты, выводы оформите в аналитической записке.

Задача 2

Исследуя спрос на телевизоры марки N, аналитический отдел компании ABC по данным, собранным по 19 торговым точкам компании, выявил следующую зависимость:

$$\ln y = 10,5 - 0,8 \ln x + \varepsilon$$

$$(2.5) \quad (-4,0)$$

где y – объём продаж телевизоров марки N в отдельной торговой точке;

x – средняя цена телевизора в данной торговой точке;

В скобках приведены фактические значения t-критерия Стьюдента для параметров уравнения регрессии.

Задание:

До проведения этого исследования администрация компании предполагала, что эластичность спроса по цене для телевизоров N составляет $-0,9$. Подтвердилось ли предположение администрации результатами исследования?

Задача 3

Для трех видов продукции А, В и С модели зависимости удельных постоянных расходов от объёма выпускаемой продукции выглядят следующим образом:

$$Y_A = 600,$$

$$Y_B = 80 + 0,7x$$

$$Y_C = 40x^{0,5}.$$

Задание:

1. Определите коэффициенты эластичности по каждому виду продукции и поясните их смысл.

- Сравните при $x = 1000$ эластичность затрат для продукции В и С.
- Определите, каким должен быть объём выпускаемой продукции, чтобы коэффициенты эластичности для продукции В и С были равны.

Задача 4

Пусть имеется следующая модель регрессии, характеризующая зависимость y от x :

$$Y = 8 - 7x + \varepsilon$$

Известно также, что $r_{xy} = -0,5$; $n = 20$.

Задание:

- Постройте доверительный интервал для коэффициента регрессии в этой модели:
 - с вероятностью 0,9;
 - с вероятностью 0,99.
- Проанализируйте результаты, полученные в п. 1, и поясните причины их различий.

Задача 5

Зависимость среднемесячной производительности труда от возраста рабочих характеризуется моделью: $y = a + bx + cx^2$. Ее использование привело к результатам, представленным в таблице:

| № п/п | Производительность труда рабочих, тыс. руб., y | | № п/п | Производительность труда рабочих, тыс. руб. | |
|-------|--|-----------|-------|---|-----------|
| | Фактическая | Расчётная | | Фактическая | Расчётная |
| 1 | 12 | 10 | 6 | 11 | 12 |
| 2 | 8 | 10 | 7 | 12 | 13 |
| 3 | 13 | 13 | 8 | 9 | 10 |
| 4 | 15 | 14 | 9 | 11 | 10 |
| 5 | 16 | 15 | 10 | 9 | 9 |

Задание:

Оцените качество модели, определив ошибку аппроксимации, индекс корреляции и F-критерий Фишера

Задача 6

Моделирование прибыли фирмы по уравнению $y = ab^x$ привело к результатам, представленным в таблице:

| № п/п | Производительность труда рабочих, тыс. руб., y | | № п/п | Производительность труда рабочих, тыс. руб. | |
|-------|--|-----------|-------|---|-----------|
| | Фактическая | Расчётная | | Фактическая | Расчётная |
| 1 | 10 | 11 | 5 | 18 | 20 |
| 2 | 12 | 11 | 6 | 11 | 11 |
| 3 | 15 | 17 | 7 | 13 | 14 |
| 4 | 17 | 15 | 8 | 19 | 16 |

Задание:

Оцените качество модели. Для этого:

- определите ошибку аппроксимации;
- найдите показатель тесноты связи прибыли с исследуемым в модели фактором;
- рассчитайте F-критерий Фишера. Сделайте выводы.

Задача 7

Зависимость объёма производства y (тыс. ед.) от численности занятых x (чел.) по 15 заводам концерна характеризуется следующим образом:

Уравнение регрессии $y = 30 - 0,4x + 0,04x^2$.

Доля остаточной дисперсии в общей 20%

Задание: Определите:

а) индекс корреляции;

б) значимость уравнения регрессии;

в) коэффициент эластичности, предполагая, что численность занятых составляет 30 человек.

Задача 8

По группе 10 заводов, производящих однородную продукцию, получено уравнение регрессии себестоимости единицы продукции y (тыс. руб.) от уровня технической оснащённости x (тыс. руб.):

$y = 20 + \frac{700}{x}$. Доля остаточной дисперсии в общей дисперсии составила 0,19.

Задание: Определите:

а) коэффициент эластичности, предполагая, что стоимость активных производственных фондов составляет 200 тыс. руб.

б) индекс корреляции;

в) F- критерий Фишера. Сделайте выводы.

Задача 9

Зависимость спроса на товар К от его цены характеризуется по 20 наблюдениям уравнением: $\lg y = 1.75 - 0.35 \lg x$. Доля остаточной дисперсии в общей составила 18 %.

Задание:

1. Запишите данное уравнение в виде степенной функции.

2. Оцените эластичность спроса на товар в зависимости от его цены.

3. Определите индекс корреляции и оцените значимость уравнения регрессии через F- критерий Фишера. Сделайте выводы.

Задача 10

По 20 фермам области получена информация, представленная в таблице:

| Показатель | Среднее значение | Коэффициент вариации |
|--------------------------------------|------------------|----------------------|
| Урожайность, ц/га | 27 | 20 |
| Внесено удобрений на 1 га посева, кг | 5 | 15 |

Фактическое значение F- критерия Фишера составило 45.

Задание:

1. Определите линейный коэффициент детерминации.

2. Постройте уравнение линейной регрессии.

3. Найдите обобщающий коэффициент эластичности.

4. С вероятностью 0,95 укажите доверительный интервал ожидаемого значения урожайности в предположении роста количества внесённых удобрений на 10% от своего среднего уровня.

Задача 11

Для двух видов продукции А и Б зависимость расходов предприятия y (тыс. руб.) от объёма производства x (шт.) характеризуется данными, представленными в таблице:

| Уравнение регрессии | Показатели корреляции | Число наблюдений |
|---------------------|-----------------------|------------------|
|---------------------|-----------------------|------------------|

| | | |
|--------------------|------|----|
| $y_A = 160 + 0,8x$ | 0,85 | 30 |
| $y_B = 50x^{0,6}$ | 0,72 | 25 |

Задание:

1. Поясните смысл величин 0,8 и 0,6 в уравнениях регрессии.
2. Сравните эластичность расходов от объёма производства для продукции А и Б при выпуске продукции А в 500 единиц.
3. Определите каким должен быть выпуск продукции А, чтобы эластичность её расходов совпадала с эластичностью расходов на продукцию Б.
4. Оцените значимость каждого уровня регрессии с помощью F-критерия Фишера.

Задача 12

По совокупности на 30 предприятиях концерна изучается зависимость прибыли Y (тыс. руб.) от выработки продукции на одного работника X_1 (ед.) и индекса цен на продукцию X_2 (%):

| ПП риз нак | Среднее значение | | | | Среднее квадратическое отклонение | | | | Парный коэффициент корреляции | | | | |
|------------------|------------------|-----|-----|-----|---|----|----|----|----------------------------------|----------|------|------|------|
| | Варианты | | | | Варианты | | | | | Варианты | | | |
| | 1 | 2 | 3 | 4 | 1 | 2 | 3 | 4 | | 1 | 2 | 3 | 4 |
| Y | 250 | 200 | 240 | 280 | 38 | 34 | 36 | 40 | r_{yX_1} | 0.68 | 0.65 | 0.67 | 0.69 |
| X_1 | 47 | 45 | 48 | 50 | 12 | 10 | 12 | 14 | r_{yX_2} | 0.63 | 0.60 | 0.61 | 0.65 |
| X_2 | 112 | 100 | 115 | 118 | 21 | 20 | 22 | 23 | $r_{X_1X_2}$ | 0.42 | 0.40 | 0.44 | 0.43 |

Задание:

1. Постройте линейные уравнения парной регрессии, оцените их адекватность с помощью F- критерия Фишера.
2. Найдите уравнение множественной регрессии в натуральном масштабе.
3. Рассчитайте множественный коэффициент корреляции, общий и частные критерии Фишера и сделайте выводы.

Задача 13

По 30 заводам, выпускающим продукцию А, изучается зависимость потребления электроэнергии Y (тыс. кВт. ч) от производства продукции X_1 (тыс. ед.) и уровня механизации труда X_2 (%):

| ПП риз нак | Среднее значение | | | Среднее квадратическое отклонение | | | Парный коэффициент корреляции | | | |
|------------------|------------------|------|------|---|----|----|----------------------------------|----------|------|------|
| | Варианты | | | Варианты | | | | Варианты | | |
| | 1 | 2 | 3 | 1 | 2 | 3 | | 1 | 2 | 3 |
| Y | 1000 | 900 | 1050 | 27 | 26 | 28 | r_{yX_1} | 0.77 | 0.75 | 0.78 |
| X_1 | 420 | 410 | 425 | 45 | 43 | 44 | r_{yX_2} | 0.43 | 0.42 | 0.44 |
| X_2 | 41.5 | 41.0 | 42.0 | 18 | 17 | 19 | $r_{X_1X_2}$ | 0.38 | 0.37 | 0.39 |

Задание:

1. Постройте уравнение множественной регрессии в натуральном масштабе.
2. Определите показатели частной и множественной корреляции.
3. Найдите частные коэффициенты эластичности и сравните их с β - коэффициентами.
4. Рассчитайте общий и частные F – критерии Фишера.

Задача 14

По 25 предприятиям концерна изучается зависимость потребления материалов Y (т) от энерговооружённости труда X_1 (кВт. ч на одного рабочего) и объёма произведённой продукции X_2 (тыс. ед.):

| ППр изна к | Среднее значение | | | Среднее квадратическое отклонение | | | Парный коэффициент корреляции | | | |
|------------------|------------------|------|------|---|-----|-----|----------------------------------|----------|------|------|
| | Варианты | | | Варианты | | | | Варианты | | |
| | 1 | 2 | 3 | 1 | 2 | 3 | | 1 | 2 | 3 |
| Y | 12.0 | 13.0 | 11.0 | 2.0 | 2.5 | 2.1 | r_{YX_1} | 0.52 | 0.53 | 0.51 |
| X_1 | 14.3 | 14.4 | 14.2 | 0.5 | 0.6 | 0.4 | r_{YX_2} | 0.84 | 0.85 | 0.82 |
| X_2 | 10.0 | 11.0 | 10.0 | 1.8 | 1.6 | 1.7 | $r_{X_1X_2}$ | 0.43 | 0.42 | 0.43 |

Задание:

1. Постройте уравнение множественной регрессии в натуральной форме и поясните экономический смысл его параметров.
2. Определите частные коэффициенты эластичности.
3. Найдите частные и множественный коэффициенты корреляции.
4. Оцените значимость уравнения регрессии с помощью F- критерия Фишера.

Задача 15

Задание к задачам 15 – 24

1. Применив необходимое и достаточное условие идентификации, определите, идентифицируемо ли каждое из уравнений модели.
2. Определите метод оценки параметров модели.
3. Запишите приведённую форму модели.

Одна из версий модифицированной модели Кейнса имеет вид:

$$C_t = a_1 + b_{11}Y_t + b_{12}Y_{t-1} + \varepsilon_1,$$

$$I_t = a_2 + b_{21}Y_t + b_{22}Y_{t-1} + \varepsilon_2,$$

$$Y_t = C_t + I_t + G_t,$$

где C – расходы на потребление;

Y – доход;

I – инвестиции;

G – государственные расходы;

t – текущий период;

$t - 1$ – предыдущий период.

Задача 16

Модель мультипликатора – акселератора:

$$C_t = a_1 + b_{11}R_t + b_{12}C_{t-1} + \varepsilon_1,$$

$$I_t = a_2 + b_{21}(R_t - R_{t-1}) + \varepsilon_2,$$

$$R_t = C_t + I_t,$$

Где C – расходы на потребление;

R – доход;

I – инвестиции;

t – текущий период;

$t-1$ – предыдущий период.

Задача 17

Конъюнктурная модель имеет вид

$$C_t = a_1 + b_{11}Y_t + b_{12}C_{t-1} + \varepsilon_1,$$

$$I_t = a_2 + b_{21}r_t + b_{22}I_{t-1} + \varepsilon_2,$$

$$R_t = a_3 + b_{31}Y_t + b_{32}M_t + \varepsilon_3,$$

$$Y_t = C_t + I_t + G_t,$$

где C – расходы на потребление;

Y – ВВП;

I – инвестиции;

r – процентная ставка;

M – денежная масса;

G – государственные расходы;

t – текущий период;

$t-1$ – предыдущий период.

Задача 18

Модель протекционизма Сальватора (упрощённая версия):

$$M_t = a_1 + b_{12}N_t + b_{13}S_t + b_{14}E_{t-1} + b_{15}M_{t-1} + \varepsilon_1,$$

$$N_t = a_2 + b_{21}M_t + b_{23}S_t + b_{26}Y_t + \varepsilon_2,$$

$$S_t = a_3 + b_{31}M_t + b_{32}N_t + b_{37}X_t + \varepsilon_3,$$

где M – доля импорта в ВВП;

N – общее число прошений об освобождении от таможенных пошлин;

S – число удовлетворённых прошений об освобождении от таможенных пошлин;

E – фиктивная переменная, равная 1 для тех лет, в которые курс доллара на международных валютных рынках был искусственно завышен, и 0 – для всех остальных лет;

Y – реальный ВВП;

X – реальный объём чистого экспорта;

t – текущий период;

$t-1$ – предыдущий период.

Задача 19

Макроэкономическая модель (упрощённая версия модели Клейна):

$$C_t = a_1 + b_{12}Y_t + b_{13}T_t + \varepsilon_1,$$

$$I_t = a_2 + b_{21}Y_t + b_{24}K_{t-1} + \varepsilon_2,$$

$$Y_t = C_t + I_t + G_t,$$

где C – потребление;

I – инвестиции;

Y – доход;

T – налоги;

K – запас капитала;

t – текущий период;

$t-1$ – предыдущий период.

Задача 20

Модель Кейнса (одна из версий):

$$C_t = a_1 + b_{11}Y_t + b_{12}Y_{t-1} + \varepsilon_1, \quad (\text{функция потребления});$$

$$I_t = a_2 + b_{21}Y_t + \varepsilon_2, \quad (\text{функция инвестиций});$$

$$Y_t = C_t + I_t + G_t, \quad (\text{тождество дохода});$$

где C – потребление;

Y – ВВП;

G – валовые инвестиции;

t – текущий период;
 $t-1$ – предыдущий период.

Задача 21

Модель денежного и товарного рынков:

$$R_t = a_1 + b_{12}Y_t + b_{14}M_t + \varepsilon_1, \quad (\text{функция денежного рынка});$$

$$Y_t = a_2 + b_{21}R_t + b_{23}I_t + b_{25}G_t + \varepsilon_2, \quad (\text{функция товарного рынка});$$

$$I_t = a_3 + b_{31}R_t + \varepsilon_3, \quad (\text{функция инвестиций}),$$

где R – процентные ставки;

Y – реальный ВВП;

M – денежная масса;

I – внутренние инвестиции;

G – реальные государственные расходы.

Задача 22

Модифицированная модель Кейнса:

$$C_t = a_1 + b_{11}Y_t + \varepsilon_1,$$

$$I_t = a_2 + b_{21}Y_t + b_{22}Y_{t-1} + \varepsilon_2,$$

$$Y_t = C_t + I_t + G_t,$$

где C – расходы на потребление;

I – инвестиции;

Y – доход;

t – текущий период;

$t-1$ – предыдущий период.

Задача 23

Дана следующая структурная форма модели:

$$C_t = b_1 + b_2S_t + b_3P_t,$$

$$S_t = a_1 + a_2R_t + a_3R_{t-1} + a_4t,$$

$$R_t = S_t + P_t,$$

где C_t – личное потребление в период t ;

S_t – зарплата в период t ;

P_t – прибыль в период t ;

R_t – общий доход в период t ;

R_{t-1} – общий доход в период $t-1$;

$t-1$ – предыдущий период.

Задача 24

Модель денежного рынка:

$$R_t = a_1 + b_{11}M_t + b_{12}Y_t + \varepsilon_1,$$

$$Y_t = a_2 + b_{21}R_t + b_{22}I_t + \varepsilon_2,$$

$$I_t = a_3 + b_{33}R_t + \varepsilon_3,$$

где R – процентные ставки;

Y – ВВП;

M – денежная масса;

I – внутренние инвестиции.

Задача 25

Администрация банка изучает динамику депозитов физических лиц за ряд лет (млн. \$ в сопоставимых ценах). Исходные данные представлены в таблице:

| Показатели | Вариант | Значение показателей | | | | | | | Сумма |
|----------------------------|---------|----------------------|---|---|---|----|----|----|-------|
| | | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | |
| Время, лет | 1,2,3 | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 28 |
| Депозиты физических лиц, х | 1 | 2 | 6 | 7 | 3 | 10 | 12 | 13 | 53 |
| | 2 | 1 | 3 | 5 | 2 | 7 | 8 | 9 | 35 |
| | 3 | 2 | 4 | 6 | 3 | 8 | 9 | 10 | 42 |

В каждом варианте найти $\sum x^2$.

Задание:

1. Постройте уравнение линейного тренда и дайте интерпретацию его параметров.
2. Определите коэффициент детерминации для линейного тренда.
3. Администрация банка предполагает, что среднегодовой абсолютный прирост депозитов физических лиц составляет не менее 2,5 млн. \$. Подтверждается ли это предположение результатами, которые вы получили?

Задача 26

Имеются данные об урожайности культур в сельскохозяйственных предприятиях..... области:

| Варианты | Показатели | Годы | | | | | | | |
|----------|---|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| | | 11 | 22 | 33 | 44 | 55 | 66 | 77 | 88 |
| 1 | Урожайность зерновых, ц/га | 110,2 | 110,7 | 111,7 | 113,1 | 114,9 | 117,2 | 220,0 | 223 |
| 2 | Урожайность сахарной свеклы (фабричной), ц/га | 662 | 773 | 887 | 996 | 1114 | 1118 | 1142 | 1158 |
| 3 | Урожайность подсолнечника, ц/га | 44,1 | 55,8 | 66,7 | 77,2 | 88,0 | 110,1 | 111,9 | 112,3 |
| 4 | Урожайность картофеля, ц/га | 663 | 664 | 669 | 881 | 884 | 996 | 1106 | 1109 |

Задание:

1. Обоснуйте выбор типа уравнения тренда.
2. Рассчитайте параметры уравнения тренда.
3. Дайте прогноз урожайности культур на следующий год.

Задача 27

Имеются следующие данные об уровне безработицы y_t (%) за 8 месяцев:

| Варианты | Месяц | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 |
|----------|-------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
| 1 | y_t | 8,8 | 8,6 | 8,4 | 8,1 | 7,9 | 7,6 | 7,4 | 7,0 |
| 2 | | 7,8 | 7,6 | 7,4 | 7,1 | 6,9 | 6,6 | 6,4 | 6,0 |
| 3 | | 9,1 | 9,0 | 8,9 | 8,6 | 8,5 | 8,4 | 8,3 | 8,0 |

Задание:

1. Определите коэффициенты автокорреляции уровней этого ряда первого и второго порядка.
2. Обоснуйте выбор уравнения тренда и определите его параметры.
3. Интерпретируйте полученные результаты.

Требования: Самостоятельная работа по дисциплине «Эконометрика» представляет собой построение описательной эконометрической модели и ее статистический анализ по заданной теме на основе прочтения основной и дополнительной литературы, анализа Интернет-ресурсов и использования современных информационных технологий.

Критерии оценки: количество баллов: Отчет по самостоятельной работе оценивается по пятибалльной шкале, с понижением оценки при допуске студентом ошибок при реализации отдельных этапов эконометрического моделирования.

Тестовые задания по дисциплине «Эконометрика»

1. Что такое эконометрика?

- 1) наука о политической экономике;
- 2) наука об экономических измерениях;
- 3) наука об истории экономики;
- 4) наука о фондовых инвестициях.

2. Каков математический инструментарий Эконометрики?

- 1) инструментарий эконометрики составляют методы математической и прикладной статистики;
- 2) инструментарий эконометрики составляют методы индукции и дедукции;
- 3) инструментарий эконометрики составляют методы коллокаций и поверхностей равного расхода;
- 4) инструментарий эконометрики составляют методы Якоби и Ньютона.

3. Какие ученые внесли существенный вклад в развитие эконометрики?

- 1) А.Бутлеров и В.Бехтерев;
- 2) Э.Резерфорд и М.Скалодовская-Кюри;
- 3) Р.Фриш и Я.Тинберген;
- 4) А.Нобель и К.Гаусс.

4. Что такое случайная величина?

- 1) величина, которая может принять случайные значения;
- 2) величина, которая может принять известный набор значений с известными вероятностями;
- 3) величина про которую ничего неизвестно;
- 4) величина, которая может принять одно единственное значение.

5. Что такое – числовая характеристика случайной величины?

- 1) число равное одному из значений случайной величины;
- 2) число равное наибольшему значению случайной величины;
- 3) число равное наименьшему значению случайной величины;
- 4) число, в концентрированной форме выражающее существенные черты распределения случайной величины.

6. Что такое матожидание случайной величины?

- 1) наименьшее значение случайной величины;
- 2) наибольшее значение случайной величины;
- 3) среднее по вероятности ожидаемое значение случайной величины;
- 4) разность между наибольшим и наименьшим значениями случайной величины.

7. Что такое дисперсия случайной величины?

- 1) дисперсия определяет величину разброса значений случайной величины относительно ее максимального значения;
- 2) дисперсия определяет величину разброса значений случайной величины относительно ее минимального значения;
- 3) дисперсия определяет величину разброса значений случайной величины относительно ее математического ожидания;
- 4) дисперсия определяет разницу между максимальным и минимальным значениями случайной величины.

8. Что характеризует коэффициент парной корреляции r_{xy} ?

- 1) коэффициент парной корреляции дает количественную оценку тесноты квадратичной зависимости между переменными x и y ;
- 2) коэффициент парной корреляции дает количественную оценку тесноты кубической зависимости между переменными x и y ;
- 3) коэффициент парной корреляции дает количественную оценку тесноты логарифмической зависимости между переменными x и y ;
- 4) коэффициент парной корреляции дает количественную оценку тесноты линейной зависимости между переменными x и y .

9. В каком диапазоне изменяются значения коэффициента парной корреляции r_{xy} между переменными x и y ?

- 1) в диапазоне: $0 \leq r_{xy} \leq 1$;
- 2) в диапазоне: $-1 \leq r_{xy} \leq 0$;
- 3) в диапазоне: $-0,5 \leq r_{xy} \leq 0,5$;
- 4) в диапазоне: $-1 \leq r_{xy} \leq 1$.

10. По какому критерию проверяется значимость коэффициента парной корреляции?

- 1) по критерию Стьюдента;
- 2) по критерию Фишера-Снедекора;
- 3) по критерию Кохрена;
- 4) по критерию Дарбина-Уотсона.

11. Что характеризует коэффициент детерминации R^2 ?

- 1) долю дисперсии, объясняемой переменной объясненную построенным уравнением регрессии;
- 2) долю дисперсии объясняемой переменной необъясненную построенным уравнением регрессии;
- 3) долю дисперсии объясняющей переменной объясненную построенным уравнением регрессии;
- 4) долю дисперсии объясняющей переменной не объясненную построенным уравнением регрессии;

12. В каком диапазоне изменяются значения коэффициента детерминации R^2 ?

- 1) в диапазоне: $-1 \leq R^2 \leq 1$;
- 2) в диапазоне: $0 \leq R^2 \leq 1$;
- 3) в диапазоне: $-1 \leq R^2 \leq 0$;
- 4) в диапазоне: $-0,5 \leq R^2 \leq 0,5$

13. Коэффициентам детерминации R^2 называется отношение:

- 1) $R^2 = \frac{\text{var}(\hat{y})}{\text{var}(y)}$;

$$2) R^2 = \frac{\text{var}(e)}{\text{var}(y)};$$

$$3) R^2 = \frac{\text{var}(\hat{y})}{\text{var}(y)};$$

$$4) R^2 = \frac{\text{var}(y)}{\text{var}(e)};$$

R²? 14. По какому критерию проверяется значимость коэффициента детерминации

- 1) по критерию Стьюдента;
- 2) по критерию Дарбина-Уотсона.
- 3) по критерию Фишера-Снедекора;
- 4) по критерию Кохрена;

15. Что означает условие гомоскедастичности?

- 1) независимость дисперсии случайного члена от номера наблюдения;
- 2) зависимость дисперсии случайного члена от номера наблюдения;
- 3) независимость дисперсии объясняемой переменной y от номера наблюдения;
- 4) зависимость дисперсии объясняемой переменной y от номера наблюдения.

16. Что означает условие гетероскедастичности?

- 1) зависимость дисперсии объясняемой переменной y от номера наблюдения;
- 2) зависимость дисперсии случайного члена от номера наблюдения;
- 3) независимость дисперсии объясняемой переменной y от номера наблюдения;
- 4) независимость дисперсии случайного члена от номера наблюдения.

17. Что означает условие автокорреляции остатков?

- 1) некоррелированность значений случайного члена для разных наблюдений;
- 2) коррелированность значений случайного члена для разных наблюдений;
- 3) некоррелированность значений объясняющей переменной в разных наблюдениях;
- 4) коррелированность значений объясняющей переменной в разных наблюдениях.

18. Что такое эластичность функции $y=f(x)$?

$$1) \varepsilon = \frac{y}{x} f'(x);$$

$$2) \varepsilon = \frac{x}{y} f'(x);$$

$$3) \varepsilon = x f'(x);$$

$$4) \varepsilon = \frac{1}{y} f'(x);$$

19. Что означает свойство несмещенности оценки b параметра генеральной совокупности β ?

- 1) $M(b) = 0$;
- 2) $M(b) \neq 0$;
- 3) $M(b) = \beta$;
- 4) $M(b) \neq \beta$.

20. Что означает свойство эффективности оценки b параметра генеральной совокупности β ?

- 1) оценка b обладает наибольшей дисперсией среди всех несмещенных оценок, построенных по данной выборке;
- 2) оценка b обладает наименьшей дисперсией среди всех несмещенных оценок, построенных по данной выборке;
- 3) оценка b обладает наибольшей дисперсией среди всех смещенных оценок, построенных по данной выборке;
- 4) оценка b обладает наименьшей дисперсией среди всех смещенных оценок, построенных по данной выборке;

21. Что означает свойство состоятельности оценки b параметра генеральной совокупности β ?

- 1) оценка b называется состоятельной, если; $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|b - \beta| < \varepsilon) = 1$;
- 2) оценка b называется состоятельной, если $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|b - \beta| > \varepsilon) = 1$;
- 3) оценка b называется состоятельной, если $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|b - \beta| < \varepsilon) = 0$;
- 4) оценка b называется состоятельной, если $\lim_{n \rightarrow \infty} P(|b - \beta| > \varepsilon) = 0,5$;

22. Как влияет отсутствие в модели переменной, которая должна быть в нее включена?

- 1) никак не влияет на оценки параметров уравнения регрессии;
- 2) оценки параметров уравнения регрессии получаются смещенными;
- 3) оценки параметров уравнения регрессии получаются неэффективными;
- 4) оценки параметров уравнения регрессии получаются несостоятельными.

23. Как влияет включение в модель переменной, которая не должна туда входить?

- 1) оценки параметров уравнения регрессии получаются смещенными;
- 2) никак не влияет на оценки параметров уравнения регрессии;
- 3) оценки параметров уравнения регрессии вообще говоря, хотя и не всегда, получаются неэффективными;
- 4) оценки параметров уравнения регрессии получаются эффективными.

24. Что такое лаговая переменная?

- 1) переменная, значения которой не зависят от времени;
- 2) переменная, влияние которой на объясняемую переменную характеризуется протяженностью по времени;
- 3) переменная, поведение которой определяется в самой эконометрической модели;
- 4) переменная, влияние которой на объясняемую переменную не характеризуется протяженностью по времени.

25. Что собой представляет фиктивная переменная?

- 1) переменная, принимающая количественные значения;
- 2) качественная переменная, имеющая два или несколько уровня (градаций);
- 3) переменная, поведение которой определяется в самой эконометрической модели;
- 4) переменная, влияние которой на объясняемую переменную характеризуется протяженностью по времени.

26. Какая эконометрическая модель называется динамической?

- 1) эконометрическая модель, содержащая в качестве объясняющих переменных не только значения в текущий момент времени, но и лаговые их значения;
- 2) эконометрическая модель, содержащая в качестве объясняющих переменных только текущие их значения;
- 3) эконометрическая модель, содержащая в качестве объясняющей переменной время;
- 4) эконометрическая модель, содержащая два и более уравнений.

27. Какая эконометрическая модель называется моделью авторегрессии?

- 1) эконометрическая модель, содержащая в качестве объясняющей переменной время;
- 2) эконометрическая модель, содержащая в качестве объясняющих переменных не только значения в текущий момент времени, но и лаговые их значения;
- 3) эконометрическая модель, содержащая в качестве объясняющей переменной лаговое значение объясняемой переменной;
- 4) эконометрическая модель, содержащая два и более уравнения.

28. Что собой представляет структурная форма уравнений эконометрической модели?

- 1) структурная форма уравнений – это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается через объясняющие переменные;
- 2) структурная форма уравнений - это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается через лаговые объясняющие переменные;
- 3) структурная форма уравнений - это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается через объясняющие переменные и объясняемые переменные других уравнений модели;
- 4) структурная форма уравнений - это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается через объясняющие переменные остальных уравнений модели.

29. Что собой представляет приведенная форма уравнений эконометрической модели?

- 1) приведенная форма уравнений – это такая форма уравнений эконометрической модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается только через объясняющие переменные;
- 2) приведенная форма уравнений – это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается только через лаговые объясняющие переменные;
- 3) приведенная форма уравнений – это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении объясняемая переменная выражается только через объясняющие переменные и объясняемые переменные других уравнений модели;
- 4) приведенная форма уравнений – это такая форма уравнений модели, когда в каждом уравнении модели объясняемая переменная выражается только через объясняемые переменные остальных уравнений модели.

30. Какая структурная модель считается идентифицируемой?

- 1) структурная модель считается идентифицируемой, если хотя бы один ее структурный коэффициент идентифицируем;
- 2) структурная модель считается идентифицируемой, если у неё идентифицируемы все её структурные коэффициенты кроме одного;
- 3) структурная модель считается идентифицируемой, если каждое её уравнение идентифицируемо;
- 4) структурная модель считается идентифицируемой, если у неё идентифицируемы все уравнения кроме одного.

31. Что такое дискретная случайная величина?

- 1) Случайная величина, принимающая конечное или счетное число изолированных друг от друга значений;
- 2) Случайная величина, принимающая бесконечное число значений;
- 3) Случайная величина, принимающая неизвестное число значений;
- 4) Случайная величина, принимающая одно единственное значение.

32. Что такое непрерывная случайная величина?

- 1) Случайная величина, принимающая неизвестное число значений;
- 2) Случайная величина, принимающая конечное или счетное число изолированных друг от друга значений;
- 3) Случайная величина, принимающая бесконечное число неизоллированных друг от друга значений;
- 4) Случайная величина, принимающая единственное значение.

33. Какая функция $F(x)$ называется функцией распределения случайной величины X

- 1) $F(x) = P(X < x)$
- 2) $F(x) = P(X \geq x)$
- 3) $F(x) = P(X < 0)$
- 4) $F(x) = P(X > 0)$

34. В каком диапазоне изменяется функция распределения $F(x)$ случайной величины X ?

- 1) $-\infty \leq F(x) \leq +\infty$
- 2) $0 \leq F(x) \leq +\infty$
- 3) $-\infty \leq F(x) \leq 0$
- 4) $0 \leq F(x) \leq 1$

35. Каким образом выражается плотность вероятности $y(x)$ непрерывной случайной величины x через её функцию распределения $F(x)$?

- 1) $y(x) = F'(x)$
- 2) $y(x) = F''(x)$
- 3) $y(x) = F(x) - F(0)$
- 4) $y(x) = \int_0^x F(x) dx$

36. Чему равен несобственный интеграл в бесконечных пределах от плотности вероятности непрерывной случайной величины X т.е. $\int_{-\infty}^{+\infty} y(x) dx$?

$$1) \int_{-\infty}^{+\infty} y(x) dx = 0$$

$$3) \int_{-\infty}^{+\infty} y(x) dx = 1$$

$$2) \int_{-\infty}^{+\infty} y(x) dx = +\infty$$

$$4) \int_{-\infty}^{+\infty} y(x) dx = -1$$

37. Как определяется математическое ожидание непрерывной случайной величины X?

$$1) M(x) = \int_0^{+\infty} y(x) dx$$

$$2) M(x) = \int_0^{+\infty} xy(x) dx$$

$$3) M(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} xy(x) dx$$

$$4) M(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2 y(x) dx$$

38. Как определяется дисперсия непрерывной случайной величины X, с математическим ожиданием $M(x) = 0$

$$1) D(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} x y^2(x) dx$$

$$2) D(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} (x - a)^2 y(x) dx$$

$$3) D(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2 y(x) dx$$

$$4) D(x) = \int_{-\infty}^{+\infty} x^2 y^2(x) dx$$

39. Чему равно $M(c)$, где c – константа?

$$1) M(c) = 0$$

$$2) M(c) = 2c$$

$$3) M(c) = c$$

$$4) M(c) = c^2$$

40. Чему равно $M(kx)$, где k – константа, а X – случайная величина?

$$1) M(kx) = 0$$

$$2) M(kx) = k^2 M(x)$$

$$3) M(kx) = M(x) / k$$

$$4) 1) M(kx) = k M(x)$$

41. Чему равно $M(x+y)$, где X, Y – случайные величины?

$$1) M(x+y) = M(x) + M(y)$$

$$2) M(x+y) = M(x) - M(y)$$

$$3) M(x+y) = 0$$

$$4) M(x+y) = M(x)^2 + 2M(x) \cdot M(y) + M(y)^2$$

42. Чему равно $M(x \pm c)$, где X – случайная величина, c – константа?

- 1) $M(x \pm c) = M(x)$
- 2) $M(x \pm c) = M(x)^2$
- 3) $M(x \pm c) = c$
- 4) $M(x \pm c) = M(x) \pm c$

43. Чему равна $D(c)$, где c – постоянная величина?

- 1) $D(c) = c^2$
- 2) $D(c) = 0$
- 3) $D(c) = -c^2$
- 4) $D(c) = c$

44. Чему равна $D(kx)$, где k – константа, X – случайная величина?

- 1) $D(kx) = k D(x)$
- 2) $D(kx) = 0$
- 3) $D(kx) = k^3 D(x)$
- 4) $D(kx) = k^2 D(x)$

45. Чему равна $D(x)$ случайной величины X , если её математическое ожидание есть $M(x)$?

- 1) $D(x) = (M(x))^2$
- 2) $D(x) = M(x^2) - M(x)$
- 3) $D(x) = M(x^2) - (M(x))^2$
- 4) $D(x) = (M(x^2) - M(x))^2$

46. Чему равна $D(x+y)$ случайных величин x и y ?

- 1) $D(x+y) = D(x) + D(y)$
- 2) $D(x+y) = D(x) - D(y)$
- 3) $D(x+y) = D^2(x) + D^2(y)$
- 4) $D(x+y) = D((x+y)^2) - D^2(x+y)$

47. Что означает мультиколлинеарность?

- 1) Мультиколлинеарность – это сильная коррелированность объясняемой переменной с одной из объясняющих переменных, входящих в уравнение регрессии.
- 2) Мультиколлинеарность – это отсутствие значимой корреляции между объясняемой переменной и объясняющими переменными, входящими в уравнение регрессии.
- 3) Мультиколлинеарность – это коррелированность двух или нескольких объясняющих переменных в уравнении регрессии.
- 4) Мультиколлинеарность – это отсутствие значимой корреляции между объясняющими переменными, входящими в уравнение регрессии.

48. К каким последствиям приводит мультиколлинеарность?

- 1) Никаким последствиям наличие мультиколлинеарности не приводит.
- 2) Приводит к незначительным последствиям, которые без ущерба для значимости уравнения регрессии можно проигнорировать.
- 3) МНК оценки модели не существуют.
- 4) МНК оценки имеют большие стандартные ошибки, в то время как модель является значимой.

49. Как можно избавиться от мультиколлинеарности?

- 1) Избавляться от нее нет необходимости, потому что она серьезных последствий не вызывает.

- 2) Исключить из модели все объясняющие переменные кроме одной.
- 3) Исключить из модели те объясняющие переменные, которые значимо коррелированы с оставляемыми в модели.
- 4) Исключить из модели объясняющую переменную наиболее сильно коррелированную с объясняемой переменной.

50. Что такое лаг?

- 1) Сдвиг τ , характеризующий опережающее воздействие объясняющей переменной на объясняемую.
- 2) Период времени τ , за который объясняемая переменная претерпевает определенные изменения.
- 3) Период времени τ , за который одна из объясняющих переменных претерпевает определенные изменения.
- 4) Сдвиг τ , характеризующий запаздывание в воздействию объясняющей переменной на объясняемую переменную.

51. При помощи какой статистики проверяется значимость коэффициента парной корреляции r ?

- 1) $t = \sqrt{r(n-2)/(1-r)}$,
- 2) $t = r\sqrt{(n-2)/(1-r)}$,
- 3) $t = r\sqrt{(n-2)/(1-r^2)}$,
- 4) $t = r^2\sqrt{(n-2)/(1-r^2)}$.

52. При помощи какой статистики проверяется значимость коэффициента детерминации R^2 в случае парной линейной регрессии.

- 1) $F = R(n-2)/(1-R^2)$
- 2) $F = R^2(n-2)/(1-R^2)$
- 3) $F = R^2(n-2)/(1-R)$
- 4) $F = R(n-2)/(1-R)$

53. По какой формуле вычисляется коэффициент b в уравнении парной линейной регрессии $y = a + bx$?

- 1) $b = \text{cov}^2(x, y) / D(y)$
- 2) $b = \text{cov}(x, y) / D(y)$
- 3) $b = \text{cov}(x, y) / D(x)$
- 4) $b = \text{cov}(x, y) / D(x)$.

54. По какой формуле вычисляется коэффициент a в уравнении парной линейной регрессии $y = a + bx$?

- 1) $a = \bar{y} + b\bar{x}$
- 2) $a = \bar{y} + b^2\bar{x}$
- 3) $a = \bar{y} - b\bar{x}$
- 4) $a = \bar{y} - b(\bar{x})^2$.

55. С помощью какой статистики проверяется значимость коэффициента a и уравнения парной линейной регрессии $y = a + bx$?

- 1) $t = Sa/a$
- 2) $t = |a|/Sa$

$$3) t = |a|/Sa^2$$

$$4) t = Sa^2/|a|$$

56. При помощи какой статистики проверяется значимость коэффициента b из уравнения парной линейной $y = a + bx$?

$$1) t = S^2 b/b$$

$$2) t = b/S^2 b$$

$$3) t = b^2/Sb$$

$$4) t = |b| /Sb$$

57. Есть ли зависимость между коэффициентом парной корреляции r_{xy} и детерминации R^2 в случае парной линейной регрессии?

1) Никакой зависимости нет,

2) Зависимость есть и она выражается формулой: $r_{xy} = R^2$,

3) Зависимость есть и она выражается формулой: $r_{xy}^2 = R^2$,

4) Зависимость есть и она выражается формулой: $r_{xy}^2 = R$.

58. Каким методом находятся оценки параметров уравнения регрессии?

1) Методом максимального правдоподобия.

2) Методом наименьших квадратов.

3) Методом наибольших квадратов.

4) Методом средних квадратов.

59. Что понимается под прогнозированием в эконометрике?

1) Под прогнозированием в эконометрике понимается построение оценки объясняемой переменной для некоторого набора объясняющих переменных, которых нет в исходных наблюдениях.

2) Под прогнозированием в эконометрике понимается построение оценки одной из объясняющей переменной для некоторого набора оставшихся объясняющих переменных, которых нет в исходных наблюдениях.

3) Под прогнозированием в эконометрике понимается построение оценки объясняемой переменной для некоторого набора объясняющих переменных, которые есть в исходных наблюдениях.

4) Под прогнозированием в эконометрике понимается построение оценки одной объясняющей переменной для некоторого набора оставшихся объясняющих переменных, которые есть в исходных наблюдениях.

60. По какой формуле вычисляется коэффициент ковариации между случайными величинами x и y ?

$$1) \text{cov}(x, y) = \frac{1}{n-1} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})^2 y_i,$$

$$2) \text{cov}(x, y) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y})^2,$$

$$3) \text{cov}(x, y) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x})(y_i - \bar{y}),$$

$$4) \text{cov}(x, y) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n x_i (y_i - \bar{y}).$$

61. Чему равняется $\text{cov}(x, a)$, где X - случайная величина, a - константа?

- 1) $\text{cov}(x, a) = a$,
- 2) $\text{cov}(x, a) = -a$,
- 3) $\text{cov}(x, a) = 0$,
- 4) $\text{cov}(x, a) = 2a$.

62. Чему равняется $\text{cov}(x, by)$, если b – константа, X, Y – случайные величины?

- 1) $\text{cov}(x, by) = b^2 \text{cov}(x, y)$,
- 2) $\text{cov}(x, by) = -b \text{cov}(x, y)$,
- 3) $\text{cov}(x, by) = 0$,
- 4) $\text{cov}(x, by) = b \text{cov}(x, y)$.

63. Чему равняется $\text{Var}(x+y)$, где X, Y – случайные величины?

- 1) $\text{Var}(x + y) = \text{Var}(x) + \text{Var}(y)$,
- 2) $\text{Var}(x + y) = \text{Var}^2(x) + \text{Var}^2(y)$,
- 3) $\text{Var}(x + y) = \text{Var}(x) + \text{Var}(y) + 2 \text{cov}(x, y)$,
- 4) $\text{Var}(x + y) = \text{Var}(x) + 2\text{Var}(x) \cdot \text{Var}(y) + \text{Var}(y)$.

64. Чему равняется $\text{cov}(x, y)$, если X, Y – независимые случайные величины?

- 1) $\text{cov}(x, y) = 1$,
- 2) $\text{cov}(x, y) = -1$,
- 3) $\text{cov}(x, y) = 0$,
- 4) $\text{cov}(x, y) = M(x) \cdot M(y)$

65. Чему равняется $\text{cov}(x, y+z)$, где x, y, z – случайные величины?

- 1) $\text{cov}(x, y+z) = \text{cov}(x, y) + \text{cov}(x, z)$
- 2) $\text{cov}(x, y+z) = \text{cov}(x, z) + \text{cov}(y, z)$
- 3) $\text{cov}(x, y+z) = \text{cov}(x, y) + \text{cov}(x, z)$
- 4) $\text{cov}(x, y+z) = \text{cov}(z, y) + \text{cov}(z, x)$

66. Чему равняется $\text{cov}(x, x)$, где X – случайная величина?

- 1) $\text{cov}(x, x) = M(x)^2$
- 2) $\text{cov}(x, x) = M(x^2)$
- 3) $\text{cov}(x, x) = M(x^2) - M(x)^2$
- 4) $\text{cov}(x, x) = M(x^2) + M(x)^2$.

67. По какой из формул вычисляется выборочный коэффициент парной корреляции r_{xy} ?

- 1) $r_{xy} = \frac{\text{cov}(x, y)}{D(x) \cdot D(y)}$
- 2) $r_{xy} = \frac{\text{cov}(x, y)}{M(x) \cdot M(y)}$
- 3) $r_{xy} = \frac{\text{cov}(x, y)}{\sqrt{M(x)} \cdot \sqrt{M(y)}}$
- 4) $r_{xy} = \frac{\text{cov}(x, y)}{\sqrt{D(x)} \cdot \sqrt{D(y)}}$

68. Как соотносятся между собой $\bar{\hat{y}}$ и \bar{y} ?

- 1) $\bar{\hat{y}} > \bar{y}$
- 2) $\bar{\hat{y}} < \bar{y}$

3) $\bar{\hat{y}} = -\bar{y}$

4) $\bar{\hat{y}} = \bar{y}$

69. Как соотносятся между собой r_{xy} и R^2 ?

1) $r_{xy} = R^2$,

2) $r_{xy} = -R^2$,

3) $r_{xy} = 2R$,

4) $r_{xy} = \sqrt{R^2}$.

70. Какое соотношение определяет первое условие Гаусса – Маркова?

1) $D(\varepsilon_i) = \sigma^2$ ($i = \overline{1, n}$),

2) $D(\varepsilon_i) = \sigma_i^2$ ($i = \overline{1, n}$),

3) $M(\varepsilon_i) = 1$ ($i = \overline{1, n}$),

4) $M(\varepsilon_i) = 0$ ($i = \overline{1, n}$).

71. Какое соотношение определяет второе условие Гаусса-Маркова?

1) $M(\varepsilon_i) = 0$ ($i = \overline{1, n}$),

2) $M(\varepsilon_i \varepsilon_j) = 0$ ($i \neq j$),

3) $D(\varepsilon_i) = \sigma^2$ ($i = \overline{1, n}$),

4) $D(\varepsilon_i) = \sigma_i^2$ ($i = \overline{1, n}$).

72. Какое соотношение определяет третье условие Гаусса-Маркова?

1) $M(\varepsilon_i) = 0$ ($i = \overline{1, n}$),

2) $D(\varepsilon_i) = \sigma^2$ ($i = \overline{1, n}$),

3) $D(\varepsilon_i) = \sigma_i^2$ ($i = \overline{1, n}$),

2) $M(\varepsilon_i \varepsilon_j) = 0$ ($i \neq j$).

73. Какое утверждение заложено в четвёртое условие Гаусса – Маркова?

1) Объясняемая переменная величина неслучайная.

2) Объясняемая переменная величина случайная.

3) Объясняющая переменная величина случайная.

4) Объясняющая переменная величина неслучайная.

74. В модели парной линейной регрессии $\hat{y} = a + bx$ величина дисперсии коэффициента a вычисляется по формуле:

1) $D(a) = \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$,

2) $D(a) = \bar{x} \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$,

3) $D(a) = \bar{x}^2 \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$,

4) $D(a) = \bar{x}^2 \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$.

75. В модели парной линейной регрессии $\hat{y} = a + bx$ величина дисперсии коэффициента b вычисляется по формуле:

1) $D(b) = \bar{x}^2 \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$,

2) $D(b) = \bar{x}^2 \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$,

3) $D(b) = \sigma / (n \text{Var}(x))$,

4) $D(b) = \sigma^2 / (n \text{Var}(x))$.

76. Для модели парной линейной остаточная дисперсия вычисляется по формуле:

1) $S^2 = \frac{n-2}{n}Var(e)$

2) $S^2 = \frac{n-1}{n}Var(e)$

3) $S^2 = \frac{n}{(n-1)}Var(e)$

4) $S^2 = \frac{n}{n-2}Var(e)$

77. Каким образом устраняется нелинейность регрессии по переменным?

1) Нелинейность регрессии по переменным невозможно устранить.

2) Нелинейность регрессии по переменным устраняется путем логарифмирования обеих частей уравнения.

3) Нелинейность регрессии по переменным устраняется путем потенцирования обеих частей уравнения.

4) Нелинейность регрессии по переменным устраняется путем замены объясняющих переменных на новые.

78. Каким образом устраняется нелинейность регрессии по параметру?

1) Нелинейность регрессии по параметру устраняется путем замены переменных на новые.

2) Нелинейность уравнения по параметру часто устраняется путем логарифмического преобразования уравнения.

3) Нелинейность регрессии по параметру устраняется путем потенцирования обеих частей уравнения.

4) Нелинейность регрессии по параметру устраняется путем обратного пропорционального преобразования.

79. Что такое ошибка предсказания в регрессионной модели?

1) Ошибка предсказания в регрессионной модели это разность между наибольшим и наименьшим значениями объясняемой переменной.

2) Ошибка предсказания в регрессионной модели это разность между наибольшим в наблюдениях значением объясняемой переменной и её средним значением в наблюдениях.

3) Ошибка предсказания в регрессионной модели это разность между наименьшим в наблюдениях значением объясняемой переменной и её средним значением.

4) Ошибка предсказания в регрессионной модели равна разности между предсказанным и действительными значениями объясняемой переменной.

80. Ошибка $S^2 \Delta p$ предсказания в модели парной линейной регрессии вычисляется по формуле:

1) $S^2 \Delta p = s^2(1 + \frac{1}{n} + (x_p - \bar{x})^2 / (nVar(x)))$

2) $S^2 \Delta p = s^2(\frac{1}{n} + (x_p - \bar{x})^2 / (nVar(x)))$

3) $S^2 \Delta p = s^2(1 + (x_p - \bar{x})^2 / (nVar(x)))$

4) $S^2 \Delta p = s^2(1 + \frac{1}{n} + (x_p - \bar{x}) / (nVar(x)))$

81. Какой интервал называется доверительным интервалом для параметра β ?

- 1) Интервал в центре которого находится выборочная оценка b параметра β , и который покрывает значение параметра β с заданной вероятностью $(1 - \alpha)$.
- 2) Интервал $[-b, b]$.
- 3) Интервал $[-b - t_{кр} s_b, b + t_{кр} s_b]$.
- 4) Интервал $[0, b]$.

82. Какая переменная называется эндогенной?

- 1) Переменная, значения которой определяются в самой модели.
- 2) Переменная значения которой определяются вне модели.
- 3) Переменная, принимающая только изолированные значения из своего возможного набора значений.
- 4) Переменная, принимающая только положительные значения.

83. Какая переменная называется экзогенной?

- 1) Переменная значения которой определяются в самой модели.
- 2) Переменная, принимающая только целочисленные значения.
- 3) Переменная, принимающая только отрицательные значения.
- 4) Переменная, значения которой определяются вне модели.

84. В чем отличие тождества от уравнения в системе одновременных уравнений?

- 1) Никаких отличий нет.
- 2) Отличие заключается в отсутствии в правой части тождества случайного члена.
- 3) Отличие заключается в отсутствии в тождестве оцениваемых параметров.
- 4) Отличие заключается в отсутствии в тождестве оцениваемых параметров и случайного члена.

85. Какие методы используются для оценивания параметров структурной модели?

- 1) Метод Койка, метод Алмона трехшаговый метод наименьших квадратов.
- 2) Метод максимального правдоподобия, метод частичной коррекции, метод каллокаций.
- 3) Метод инструментальных переменных, косвенный метод наименьших квадратов, двухшаговый метод наименьших квадратов.
- 4) Метод Кохрейна – Аркатта, метод Хильдратта-Лу, метод простой итерации.

86. Чего удастся добиться введением ненулевого ограничения в структурную модель?

- 1) Ненулевое ограничение позволяет исключить одну объясняющую переменную из одного уравнения модели.
- 2) Ненулевое ограничение позволяет исключить по одной объясняющей переменной из каждого уравнения модели.
- 3) Ненулевое ограничение позволяет исключить две объясняющие переменные.
- 4) Ненулевое ограничение позволяет исключить три объясняющие переменные из уравнений модели.

87. Какая эконометрическая модель называется моделью с распределенным лагом?

- 1) Моделью с распределенным лагом называется модель, содержащая в качестве объясняющих переменных лаговые значения объясняемой переменной.
- 2) Моделью с распределенным лагом называется модель, содержащая в качестве объясняющих переменных лаговые значения объясняющей переменной.
- 3) Моделью с распределенным лагом называется модель, содержащая в качестве объясняющей переменной время.

4) Моделью с распределенным лагом называется модель с несколькими лаговыми объясняющими переменными.

88. Какая эконометрическая модель называется моделью авторегрессии?

1) Моделью авторегрессии называется модель, содержащая в качестве объясняющих переменных лаговые значения объясняемой переменной.

2) Моделью авторегрессии называется модель, содержащая в качестве объясняющих переменных лаговые значения объясняющих переменных.

3) Моделью авторегрессии называется модель, содержащая в качестве объясняющей переменной время.

4) Моделью авторегрессии называется модель, содержащая несколько лаговых объясняющие переменные.

89. Что называется краткосрочным мультипликатором в модели с распределенным лагом?

1) Коэффициент β_0 при текущем значении объясняющей переменной x_t .

2) Коэффициент β_1 при лаговом значении объясняющей переменной x_{t-1} .

3) Коэффициент α – свободный член.

4) Коэффициент $\beta = \beta_0 + \beta_1 + \dots + \beta_p$.

90. Что называется долгосрочным мультипликатором в модели с распределенным лагом?

1) Коэффициент β_0 при текущем значении объясняющей переменной x_t .

2) Коэффициент β_1 при лаговом значении объясняющей переменной x_{t-1} за предыдущий период времени.

3) Коэффициент $\beta = \beta_0 + \beta_1 + \beta_2 + \dots + \beta_p$.

4) Коэффициент α – свободный член.

91. Какая динамическая эконометрическая модель называется моделью Койка?

1) Эконометрическая модель с конечным равным p – лагом.

2) Эконометрическая модель с бесконечным лагом, коэффициенты при лаговом значениях объясняющих переменных в которой изменяются в геометрической прогрессии с коэффициентом $b > 1$.

3) Эконометрическая модель с бесконечным лагом коэффициенты при лаговых значениях объясняющих переменных в которой изменяются в геометрической прогрессии с коэффициентом $0 < b < 1$.

4) Эконометрическая модель с бесконечным лагом, коэффициенты при лаговых значениях объясняющих переменных в которой изменяются в геометрической прогрессии с коэффициентом $b < 0$.

92. Какая динамическая эконометрическая модель называется моделью полиномиальных лагов?

1) Динамическая эконометрическая модель с бесконечным лагом.

2) Динамическая модель с конечным лагом P такая, что зависимость коэффициентов при лаговых значениях объясняющей переменной от величины лага описывается полиномом m – степени, где $m \leq P$.

3) Динамическая модель с конечным лагом P такая, что зависимость коэффициентов при лаговых значениях объясняющей переменной от величины лага описывается полиномом m – степени, где $m > P$.

4) Динамическая модель с конечным лагом P такая, что зависимость коэффициентов при лаговых значениях объясняющих переменных изменяются в геометрической прогрессии с коэффициентом $0 < b < 1$.

93. По какой формуле вычисляется коэффициент a в уравнении регрессии

$$\hat{y} = a + b_1x_1 + b_2x_2 ?$$

1) $a = \bar{y} + b_1\bar{x}_1 + b_2\bar{x}_2$

2) $a = \bar{y} - b_1\bar{x}_1 + b_2\bar{x}_2$

3) $a = \bar{y} - b_1\bar{x}_1 - b_2\bar{x}_2$

4) $a = \bar{y} + b_1\bar{x}_1 - b_2\bar{x}_2$

94. При помощи какой статистики проверяется значимость коэффициента детерминации R^2 в случае множественной линейной регрессии с k - объясняющими переменными?

1) $F = \frac{R^2 K}{(1 - R^2)(n - K - 1)}$,

3) $F = \frac{R^2(n - K - 1)}{(1 - R^2)K}$,

2) $F = \frac{(1 - R^2)(n - K - 1)}{R^2 K}$,

4) $F = \frac{(1 - R^2)K}{R^2(n - K - 1)}$

95. По какой формуле в случае множественной линейной регрессии вычисляется скорректированный коэффициент детерминации?

1) $\bar{R}^2 = 1 - \frac{(n - 1)D(e)}{(n - K - 1)D(y)}$,

3) $\bar{R}^2 = 1 - \frac{(n - 1)D(\hat{y})}{(n - K - 1)D(y)}$,

2) $\bar{R}^2 = 1 - \frac{(n - K - 1)D(e)}{(n - 1)D(y)}$,

4) $\bar{R}^2 = 1 - \frac{(n - K - 1)D(\hat{y})}{(n - 1)D(y)}$.

96. Что составляет основу многошагового регрессионного анализа?

1) Основу многошагового регрессионного анализа составляет отдельное вычисление коэффициентов уравнения регрессии.

2) Основу многошагового регрессионного анализа составляет последовательный отсев несущественных факторов.

3) Основу многошагового регрессионного анализа составляет многократное вычисление оценок коэффициентов и выбор их средних значений.

4) Основу многошагового регрессионного анализа составляет многократное вычисление коэффициентов с целью определения наиболее существенного фактора.

97. Какие эконометрические модели называются причинно-следственными?

1) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными существует стохастическая зависимость.

2) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными никакой зависимости не существует.

3) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными существует причинно-следственная зависимость, причем объясняемая переменная играет роль причины.

4) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными существует причинно-следственная зависимость, причем объясняемая переменная играет роль следствия.

98. Какие эконометрические модели называются симптоматическими?

1) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными никакой зависимости нет.

2) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными существует причинно-следственная связь, причем объясняемая переменная играет роль причины.

3) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными существует причинно-следственная зависимость, причем объясняемая переменная играет роль следствия.

4) Модели, которые характеризуются тем, что их нельзя интерпретировать в категориях причин и следствия.

99. Какие эконометрические модели называются моделями тенденции развития?

1) Модели, которые характеризуются тем, что их нельзя интерпретировать в категориях причин и следствия.

2) Модели, в которых между объясняемой и объясняющими переменными нет никакой зависимости.

3) Модели, в которых наряду с пространственными объясняющими переменными присутствует в качестве объясняющей переменной время.

4) Модели, в которых объясняемые переменные представляются функциями единственной переменной времени.

100. Чем линейные эконометрические модели отличаются от нелинейных?

1) Линейные эконометрические модели отличаются от нелинейных количеством объясняющих переменных.

2) Нелинейные эконометрические модели отличаются от линейных тем, что объясняющие переменные входят в нее в нелинейной форме.

3) Нелинейные эконометрические модели отличаются от линейных тем, что параметры в них входят в нелинейной форме.

4. МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ПРОЦЕДУРЫ ОЦЕНИВАНИЯ ЗНАНИЙ, УМЕНИЙ, НАВЫКОВ И (ИЛИ) ОПЫТА ДЕЯТЕЛЬНОСТИ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Приводятся виды текущего контроля и критерии оценивания учебной деятельности по каждому ее виду по семестрам, согласно которым происходит начисление соответствующих баллов.

Лекции оцениваются по посещаемости, активности, умению выделить главную мысль. Лабораторные занятия оцениваются по самостоятельности выполнения работы, грамотности в оформлении, правильности выполнения. Практические занятия оцениваются по самостоятельности выполнения работы, активности работы в аудитории, правильности выполнения заданий, уровня подготовки к занятиям. Самостоятельная работа оценивается по качеству и количеству выполненных домашних работ, грамотности в оформлении, правильности выполнения.

Промежуточная аттестация проводится в форме зачета или зачета с оценкой.

Критерии оценки экзамена в тестовой форме: количество баллов или удовлетворительно, хорошо, отлично. Для получения соответствующей оценки на экзамене по курсу используется накопительная система балльно-рейтинговой работы студентов. Итоговая оценка складывается из суммы баллов или оценок, полученных по всем разделам курса и суммы баллов полученной на зачете с оценкой.

Таблица 4.1 - Критерии оценки уровня знаний студентов с использованием теста на зачет с оценкой по учебной дисциплине

| Оценка | Характеристики ответа студента |
|---------|--------------------------------|
| Отлично | 86-100 % правильных ответов |
| Хорошо | 71-85 % |

| | |
|---------------------|------------|
| Удовлетворительно | 51- 70% |
| Неудовлетворительно | Менее 51 % |

Количество баллов и оценка неудовлетворительно, удовлетворительно, хорошо, отлично определяются программными средствами по количеству правильных ответов к количеству случайно выбранных вопросов.

Критерии оценивания компетенций следующие:

1. Ответы имеют полные решения (с правильным ответом). Их содержание свидетельствует об уверенных знаниях обучающегося и о его умении решать профессиональные задачи, оценивается в 5 баллов (отлично);

2. Более 71 % ответов имеют полные решения (с правильным ответом). Их содержание свидетельствует о достаточных знаниях обучающегося и его умении решать профессиональные задачи – 4 балла (хорошо);

3. Не менее 50 % ответов имеют полные решения (с правильным ответом). Их содержание свидетельствует об удовлетворительных знаниях обучающегося и о его ограниченном умении решать профессиональные задачи, соответствующие его будущей квалификации – 3 балла (удовлетворительно);

4. Менее 50 % ответов имеют решения с правильным ответом. Их содержание свидетельствует о слабых знаниях обучающегося и его неумении решать профессиональные задачи – 2 балла (неудовлетворительно).

Оценка «зачтено» соответствует критериям оценок от «отлично» до «удовлетворительно».

Оценка «не зачтено» соответствует критерию оценки «неудовлетворительно».

Критерии оценки при решении задач: оценка «отлично» выставляется студенту, если он, решил задачу верно, пришел к верному знаменателю, показал умение логически и последовательно аргументировать решение задачи во взаимосвязи с практической действительностью. Оценка хорошо ставится в том случае если задача решена верно, но с незначительными погрешностями, неточностями. Оценка удовлетворительно ставится если соблюдена общая последовательность выполнения задания, но сделаны существенные ошибки в расчетах. Оценка неудовлетворительно ставится если задача не выполнена.

Критерии оценки текущих тестов: если студент выполняет правильно до 51% тестовых заданий, то ему выставляется оценка «неудовлетворительно»; если студент выполняет правильно 51-70% тестовых заданий, то ему выставляется оценка «удовлетворительно»; если студент выполняет правильно 71-85 % тестовых заданий, то ему выставляется оценка «хорошо»; если студент выполняет правильно 86-100% тестовых заданий, то ему выставляется оценка «отлично».

Критерии оценки контрольных работ студентов заочного обучения:

«Зачтено» ставится если контрольная работа выполнена в срок, не требует дополнительного времени на завершение; контрольная работа выполнена полностью: решены все задачи, даны ответы на все вопросы, имеющиеся в контрольной работе; без дополнительных пояснений используются знания, полученные при изучении дисциплин; даны ссылки на источники информации и ресурсы сети Интернет, использованные в работе; контрольная работа аккуратно оформлена, соблюдены требования ГОСТов;

«Незачтено» ставится если контрольная работа не выполнена в установленный срок, продемонстрировано полное безразличие к работе, требуется постоянная консультация для выполнения задания; в контрольной работе присутствует большое число ошибок; не полностью или с ошибками решены задачи, даны неполные или неправильные ответы на поставленные вопросы; отсутствуют ссылки на источники информации и ресурсы сети Интернет, использованные в работе; контрольная работа выполнена с нарушениями требований ГОСТов; контрольная работа выполнена по неправильно выбранному варианту.