

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Андрей Драгомирович Хлутков
Должность: директор
Дата подписания: 09.06.2026 22:00:42
Уникальный программный ключ:
880f7c07c583b07b775f6604a630281b13ca9fd2

Приложение 4
к образовательной программе

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.О.10 Эконометрика

(индекс, наименование дисциплины в соответствии с учебным планом)

38.03.01 Экономика

(код, наименование направления подготовки/специальности)

Инвестиционный бизнес

(наименование образовательной программы)

Очная форма обучения

(форма обучения)

Год набора - 2026

Санкт-Петербург

Автор(ы)-составитель(и) РПД:

Кадура Елена Вячеславовна, к.п.н., доцент кафедры бизнес-информатики

Заведующий кафедрой:

Наумов Владимир Николаевич, доктор военных наук, профессор, заведующий кафедрой бизнес-информатики

Рабочая программа дисциплины Б1.О.10 Эконометрика одобрена на заседании кафедры бизнес-информатики факультета экономики и финансов СЗИУ РАНХиГС.

протокол № 7 от «26» марта 2026 г.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине, соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы
2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы
3. Содержание и структура дисциплины
4. Типы оценочных материалов, показатели и критерии их оценивания
5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам
6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине
7. Методические материалы по освоению дисциплины
8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»
9. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

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

Дисциплина Б1.О.10 Эконометрика обеспечивает формирование у обучающихся следующих универсальных, общепрофессиональных и профессиональных компетенций*:

| ОТФ/ТФ и реквизиты ПС (при наличии)** | Код компетенции ** | Наименование Компетенции ** | Код индикатора достижения компетенций ** | Наименование индикатора достижения компетенций ** | Образовательный результат ** |
|--|---------------------------|---|---|--|---|
| | ОПК- 4 | Способен понимать принципы работы информационных технологий; использовать информацию, методы и программные средства ее сбора, обработки и анализа для информационно-аналитической поддержки принятия управленческих решений | ОПК-4.1 | Использует математические методы, математические модели и программные средства для решения задач сбора, обработки и анализа информации | ОПК-4.1 З-1 Знает: Знает основные понятия и методы теории анализа данных, теории прогнозирования, эконометрики, многомерной математической статистики ОПК-4.1 У-1 Умеет: Умеет использовать математические и инструментальные средства для анализа данных в процессе эконометрического моделирования, предикатной аналитики, сбора, обработки и анализа больших данных |
| | ОПК- 4 | Способен понимать принципы работы информационных технологий; использовать информацию, методы и программные средства ее сбора, обработки | ОПК-4.2 | Использует при решении практических задач методы и программные средства сбора информации, ее обработки и анализа для информационно-аналитической поддержки | ОПК- 4.2 З-1 Знает: Знает основные - технологии анализа данных: статистический анализ, частотный анализ, моделирование структурными уравнениями ОПК- 4.2 У-1: |

| | | | | | |
|--|--|---|--|---------------------------------|--|
| | | и анализа для информационно-аналитической поддержки принятия управленческих решений | | принятия управленческих решений | Умеет Умеет оценивать качество решения задач сбора, обработки и анализа больших данных с использованием существующей в организации методологической и технологической инфраструктуры |
|--|--|---|--|---------------------------------|--|

* Дисциплина может формировать компетенцию полностью или частично.

** Должно соответствовать Приложению 1 к образовательной программе

2. Объем и место дисциплины в структуре образовательной программы

Объем дисциплины

Объем дисциплины и виды учебной работы.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 4 зачетные единицы/144 академических/108 астрономических часов.

Дисциплина реализуется частично с применением дистанционных образовательных технологий (далее – ДОТ).

Доступ к системе дистанционных образовательных технологий осуществляется каждым обучающимся самостоятельно с любого устройства на портале: <https://lms.ranepa.ru/>. Пароль и логин к личному кабинету/профилю предоставляется студенту в деканате.

Теоретические занятия (лекции) проводятся по потокам. Общий объем лекционного курса составляет 28 академических часов.

Практические занятия организуются по группам в виде семинаров в диалоговом режиме. Общий объем практических занятий 28 академических часов.

Программой предусмотрена самостоятельная работа студентов в объеме 86 академических часа. В рамках самостоятельной работы студенты изучают теоретический материал в целях подготовки к устному опросу и тестированию, выполняют профессионально-исследовательское задание (разрабатывают модель, оценивают системы, применяют методы и средства системного анализа), готовятся к организационно-мыслительной игре и практическим контрольным заданиям.

Место дисциплины в структуре ОП ВО

Дисциплина Б1.О.10 «Эконометрика» входит в обязательную часть (Б1) дисциплин по направлению бакалавриата 38.03.01 «Экономика», направленность (профиль) «Инвестиционный бизнес». Изучается в 5-ом семестре (первый семестр 3-го курса).

Курс опирается на знание общеобразовательных дисциплин, в первую

очередь, Б1.О.05 «Микроэкономика», Б1.О.06 «Микроэкономика», Б1.О.29 «Финансы, деньги и кредит», Б1.О.07.05 «Теория вероятностей и математическая статистика».

«Эконометрика» предшествует изучению дисциплин математического цикла, так и различных социально-экономических дисциплин.

Объем дисциплины, реализуемый с применением СДО: количество академических часов, выделенных на самостоятельную работу обучающихся: всего с применением СДО – 30 а.ч.

Знания, умения и навыки, полученные при изучении дисциплины, используются студентами при подготовке и сдаче государственного экзамена.

Формой промежуточной аттестации в соответствии с учебным планом является зачет с оценкой.

3. Содержание и структура дисциплины

3.1. Структура дисциплины

Очная форма обучения

| № п/п | Наименование тем и (или) разделов | ВСЕГО | Объем дисциплины, ак.час | | | | | | | | | | Форма текущего контроля успеваемости, промежуточной аттестации | |
|--------|---|-------|---|--|---------------------------|---|--|-----|----|------------------------|--------------------------------------|------|--|---|
| | | | Контактная работа обучающихся с преподавателем по видам учебных занятий | | | | | | | Самостоятельная работа | | | | |
| | | | Период теоретического обучения | | | | Период промежуточной аттестации (сессия) | | | | | | | |
| | | | Занятия лекционного типа | | Занятия семинарского типа | | ИК | КСР | КЭ | Кат тЭК | К о н т р о л ь | СРкр | | СРэк |
| Л | ВЛ | ЛР | ПЗ | | | | | | | | | | | |
| Тема 1 | Основные понятия эконометрики. Модель парной линейной регрессии | 20 | 4 | | | 4 | | | | | | | 12 | Тестирование |
| Тема 2 | Проверка гипотез и построение доверительных интервалов в модели парной линейной регрессии | 18 | 4 | | | 2 | | | | | | | 12 | Профессионально-исследовательское задание |
| Тема 3 | Модель | 20 | 4 | | | 4 | | | | | | | 12 | Профессионально- |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------------|---|-----|----|--|--|----|--|--|---|--|--|--|----|---|
| | множественной линейной регрессии | | | | | | | | | | | | | исследовательское задание |
| Тема 4 | Гетероскедантичность, автокорреляция и мультиколлинеарность | 18 | 4 | | | 4 | | | | | | | 10 | Профессионально-исследовательское задание |
| Тема 5 | Источники смещения оценок МНК | 16 | 2 | | | 4 | | | | | | | 10 | Профессионально-исследовательское задание |
| Тема 6 | Нелинейные регрессионные модели | 18 | 4 | | | 4 | | | | | | | 12 | Тестирование, контрольная работа |
| Тема 7 | Модели временных рядов | 20 | 4 | | | 4 | | | | | | | 12 | Профессионально-исследовательское задание |
| Тема 8 | Прочие модели (обзор) | 12 | 2 | | | 2 | | | | | | | 8 | Профессионально-исследовательское задание |
| Промежуточная аттестация | | 2 | | | | | | | 2 | | | | | зачет с оценкой |
| Итого | | 144 | 28 | | | 28 | | | 2 | | | | 86 | |

Используемые сокращения:

Л – лекции - занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации обучающимся педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях,).

ВЛ – видео лекции.

ЛР – лабораторные работы.

ПЗ – практические занятия (за исключением лабораторных работ).

ИК – индивидуальные консультации.

КСР – контроль самостоятельной работы

КЭ – консультации перед экзаменом

Каттэк – контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий

Контроль - контактная работа на аттестацию в период экзаменационных сессий для заочной формы обучения

СРкр – самостоятельная работа на подготовку курсовой работы/ курсового проекта.

СРэк – самостоятельная работа на подготовку к экзамену.

СР – самостоятельная работа в семестре на подготовку к учебным занятиям.

Т – тестирование.

ПКЗ – практические контрольные задания.

ПИЗ – профессионально-исследовательские задания.

В процессе обучения применяются следующие интерактивные формы: лекция-диалог, работа в малых группах, спарринг-партнерство.

Темы 1-8 могут быть освоены с применением ЭО и ДОТ с контролем в системе электронного обучения Академии.

3.2. Содержание дисциплины

Тема 1. Основные понятия эконометрики. Модель парной линейной регрессии. ОПК-4.1.

Предмет и задачи эконометрики. Этапы эконометрического анализа. Эконометрические данные. Эконометрические модели. Описательная статистика. Статистическая модель. Корреляционный анализ. Параметрическая и непараметрическая корреляция. Задачи регрессионного анализа. Определение регрессионной модели. Классификация регрессионных моделей. Эконометрические функции. Производственные функции. Функции полезности. Функции спроса и предложения. Функции издержек. Общая характеристика статистических пакетов. Средства эконометрического моделирования. Использование статистических пакетов для решения задач регрессионного и корреляционного анализа. Low-code. JASP, jamovi, gretl. Языки аналитики.

Тема 2. Проверка гипотез и построение доверительных интервалов в модели парной линейной регрессии. ОПК-4.1.

Проверка статистических гипотез о коэффициентах регрессии и доверительные интервалы. Двусторонние и односторонние гипотезы. Регрессия с бинарной объясняющей переменной. Критерии качества приближения данных моделью и их использование для выбора модели. Нарушения предположений теоремы Гаусса-Маркова и их последствия. Использование оцененной модели для прогнозирования.

Тема 3. Модель множественной линейной регрессии. ОПК-4.2.

Линейная модель множественной регрессии (ОЛММР). Проверка качества модели. Информационные критерии. Коллинеарность факторов. Признаки мультиколлинеарности. Диагностика мультиколлинеарности. Частный коэффициент корреляции. Множественный коэффициент корреляции. Пути устранения мультиколлинеарности. Коэффициент разбухания дисперсии VIF. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК). Введение фиктивных переменных в линейную модель регрессии. Борьба с перобучением. Регуляризация модели. Ридж и лассо-регрессия.

Использование статистических пакетов для решения задач множественной регрессии. Решение задач построения линейной модели в R, JASP. Пошаговый регрессионный анализ.

Тема 4. Гетероскедантность, автокорреляция и мультиколлинеарность. ОПК-4.2.

Предположения метода наименьших квадратов для модели множественной линейной регрессии и теорема Гаусса-Маркова. Проверка выполнения предположений МНК. Нарушения предположений теоремы

Гаусса-Маркова (гетероскедастичность, мультиколлинеарность, автокоррелированность), их последствия и методы «борьбы» с ними. Критерии качества приближения данных моделью множественной линейной регрессии и их использование для выбора модели.

Тема 5. Источники смещения оценок МНК. ОПК-4.2.

Смещение из-за пропущенных переменных, смещение из-за ошибок измерения объясняющих переменных, отсутствующие данные, смещение из-за отбора наблюдений, неправильная спецификация функциональной формы регрессии. Взаимное влияние переменных. Системы одновременных уравнений. Структурная и приведенная формы. Экзогенные, эндогенные, предопределенные переменные. Идентифицируемость отдельных уравнений структурной формы. Оценивание системы одновременных уравнений. Понятие о методе инструментальных переменных.

Тема 6. Нелинейные регрессионные модели. ОПК-4.1.

Общая стратегия моделирования функции нелинейной регрессии. Виды нелинейности. Парная нелинейная регрессия. Эластичность и полуэластичность. Взаимодействие между независимыми переменными.

Тема 7. Модели временных рядов. ОПК-4.1.

Стационарные временные ряды. Процесс авторегрессии. Сезонный процесс авторегрессии. Процесс скользящего среднего. Авторегрессионный процесс с ошибками в форме скользящего среднего (ARMA(p, q)). Идентификация процесса ARMA(p, q) по поведению его автокорреляционной и частной автокорреляционной функций. Процедура Бокса-Дженкинса. Прогнозирование по модели ARMA(p, q). Нестационарные временные ряды (TS/DS), случайное блуждание, модели ARIMA. Коинтегрированные временные ряды. Свойства оценок коэффициентов регрессии при коинтегрированности переменных. Ложная (кажущаяся) регрессия. Процедура Энгла-Грейнджера. Причинность по Грейнджеру. Понятие о векторной авторегрессии.

Тема 8. Прочие модели (обзор). ОПК-4.2.

Модели бинарного выбора. Недостатки линейной вероятностной модели, пробит-модель, логит-модель. Модели множественного выбора. Модель упорядоченного множественного выбора. Модели с цензурированной зависимой переменной. Регрессионные модели для панельных данных, сбалансированные панели. Модель с фиксированными эффектами. Модель со случайными эффектами. Выбор между моделью с фиксированными эффектами и моделью со случайными эффектами.

4. Типы оценочных материалов, показатели и критерии оценивания

4.1. Оценочные материалы по дисциплине Б1.О.10 Эконометрика входят в состав оценочных материалов по образовательной программе. Совокупность оценочных материалов по всем дисциплинам образовательной программы составляет фонд оценочных средств (далее – ФОС). ФОС используется при проведении текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с целью оценивания достижения обучающимися планируемых результатов обучения.

4.2. ФОС разработан как комплекс проверочных заданий различного типа и уровня сложности, включает критерии и шкалы оценивания, а также «ключи» правильных ответов. ФОС формируется как отдельный документ и хранится в электронном виде, доступ к ФОС предоставлен ограниченному кругу лиц.

4.3. Для самостоятельной работы обучающихся при подготовке к текущему контролю успеваемости и промежуточной аттестации в рабочих программах дисциплин размещены типовые проверочные задания, которые можно условно разделить на задания закрытого, комбинированного и открытого типов.

Задания закрытого типа — это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных.

Задания комбинированного типа – это тестовые задания, в которых каждый вопрос сопровождается готовыми вариантами ответов, из которых необходимо выбрать один или несколько правильных и обосновать свой выбор.

Задания открытого типа — это задания, в которых на каждый вопрос должен быть предложен развернутый обоснованный ответ.

В зависимости от типа задания рекомендованы определенная последовательность выполнения и система оценивания выполнения заданий.

4.4. Типы заданий, сценарии выполнения, критерии оценивания

| ТИП ЗАДАНИЯ | ИНСТРУКЦИЯ | СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ | КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ |
|---|--|---|--|
| Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных | Прочитайте текст, выберите правильный ответ | <ol style="list-style-type: none"> 1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В). | Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква |
| Задание закрытого типа на установление соответствия | Прочитайте текст и установите соответствие | <ol style="list-style-type: none"> 1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов. 2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, утверждения, факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д. 3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов. 4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа (например, А1 или Б4). | Ответ считается верным, если правильно указаны цифры или буквы |
| Задание закрытого типа с выбором нескольких правильных ответов из нескольких вариантов предложенных | Прочитайте текст, выберите правильные ответы | <ol style="list-style-type: none"> 1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа. 3. Выбрать несколько правильных ответов. 4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г). | Ответ считается верным, если правильно установлены все соответствия (позиции из одного столбца верно сопоставлены с позициями другого) |
| Задание закрытого типа на установление | Прочитайте текст и установите | <ol style="list-style-type: none"> 1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается | Ответ считается верным, если правильно указана вся |

| | | | |
|---|---|---|---|
| последовательности | последовательность | последовательность элементов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Построить верную последовательность из предложенных элементов. 4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной последовательности (например, БВА или 135). | последовательность цифр |
| Задание комбинированного типа с выбором одного правильного ответа из предложенных и обоснованием выбора | Прочитайте текст, выберите правильный ответ и запишите аргументы, обосновывающие выбор ответа | 1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа. 5. Записать аргументы, обосновывающие выбор ответа (например, 4 текст обоснования). | Ответ считается верным, если правильно указана цифра или буква и приведены корректные аргументы, используемые при выборе ответа |
| Задание открытого типа с развернутым ответом | Прочитайте текст и запишите развернутый обоснованный ответ | 1. Внимательно прочитать текст задания и понять суть вопроса. 2. Продумать логику и полноту ответа. 3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки. 4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ | Ответ считается верным: 1. Отсутствие фактических ошибок. 2. Раскрытие объема используемых понятий (полнота ответа). 3. Обоснованность ответа (наличие аргументов). 4. Логическая последовательность излагаемого материала. |

4.5. Общая шкала оценивания результатов текущего контроля успеваемости и промежуточной аттестации обучающихся с применением БРС

| Итоговая балльная оценка | Традиционная система | Бинарная система | ECTS | |
|--------------------------|----------------------|------------------|--------------------------|----------------------|
| | | | Для традиционной системы | Для бинарной системы |
| 95-100 | Отлично | Зачтено | A | P/ Passed |
| 85-94 | | | B | P/ Passed |
| 75-84 | Хорошо | | C | P/ Passed |
| 65-74 | | | D | P/ Passed |
| 55-64 | Удовлетворительно | | E | P/ Passed |
| 0-54 | Неудовлетворительно | Не зачтено | F | F/Failed |

Соотношение баллов за текущий контроль успеваемости и промежуточную аттестацию, а также повторную промежуточную аттестацию:

| Максимальная сумма баллов за текущий контроль успеваемости | Максимальная сумма баллов за промежуточную аттестацию | Максимальная итоговая балльная оценка | Максимальная сумма баллов за повторную промежуточную аттестацию |
|--|---|---------------------------------------|---|
| 60 баллов | 40 баллов | 100 баллов | 100 баллов |

5. Формы аттестации, типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся, критерии и шкалы оценивания по контрольным точкам

5.1. В ходе реализации дисциплины используются следующие формы текущего контроля успеваемости обучающихся (в том числе, задания к контрольным точкам):

Т – тестирование, ПКЗ – практические контрольные задания, ПИЗ – профессионально-исследовательские задания.

Тема 1. Основные понятия эконометрики. Модель парной линейной регрессии

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве

ответа ожидается один правильный ответ из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один правильный ответ.

4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г).

1. Два студента расставили значимость предметов учебного плана по рангам. Более важному предмету соответствует меньший ранг. Студенты провели ранжирования без использования равных рангов.

| | | | | | | | | | | |
|-------------|---|---|---|---|---|----|---|----|---|----|
| | 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 | 10 |
| Предмет1,ri | 2 | 1 | 3 | 4 | 6 | 8 | 5 | 10 | 7 | 9 |
| Предмет2,si | 1 | 3 | 4 | 2 | 7 | 10 | 8 | 5 | 6 | 9 |

Оценить коэффициент корреляции Спирмена с точностью до двух знаков, используя непараметрическую статистику.

1. 0,6

2. -0,2

3. 0,7

4. 0,55

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

2. Остаточная дисперсия

Как влияет увеличение объема выборки на величину остаточной дисперсии случайной величины?

1. Никак

2. остаточная дисперсия уменьшается

3. результат зависит от конкретного вида случайной величины

4. результат необходимо верифицировать и сделать вывод о величине дисперсии. Данная величина определяет возможный вариант

5. Остаточная дисперсия увеличивается

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

3. Коэффициент парной корреляции характеризует тесноту _____ связи

между _____ переменными.

1. линейной ... несколькими
2. нелинейной ... несколькими
3. линейной ... двумя
4. нелинейной ... двумя
5. линейной, но только при построении модели линейной регрессии

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или B).

4. Точность оценки значения отклика...

1. одинаковая во всех точках области эксперимента
2. одинаковая на всем диапазоне изменения фактора
3. минимальная в центре области эксперимента и увеличивается к краям
4. одинаковая в области эксперимента и резко увеличивается к краям

ПКЗ по теме 1:

1. Частная корреляция

Имеется выборка.

| SQFT | AGE | FEATS | NE | CUST | COR | TAX | PRICE |
|------|-----|-------|----|------|-----|------|-------|
| 2650 | 13 | 7 | 1 | 1 | 0 | 1639 | 2050 |
| 2664 | 6 | 5 | 1 | 1 | 0 | 1193 | 2150 |
| 2921 | 3 | 6 | 1 | 1 | 0 | 1635 | 2150 |
| 2580 | 4 | 4 | 1 | 1 | 0 | 1732 | 1999 |
| 2580 | 4 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1534 | 1900 |
| 2774 | 2 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1765 | 1800 |
| 1920 | 1 | 5 | 1 | 1 | 0 | 1161 | 1560 |
| 1710 | 1 | 3 | 1 | 1 | 0 | 1010 | 1449 |
| 1837 | 4 | 5 | 1 | 0 | 0 | 1191 | 1375 |
| 1880 | 8 | 6 | 1 | 0 | 0 | 930 | 1270 |
| 2150 | 15 | 3 | 1 | 0 | 0 | 984 | 1250 |
| 1894 | 14 | 5 | 1 | 1 | 0 | 1112 | 1235 |
| 1928 | 18 | 8 | 1 | 1 | 0 | 600 | 1170 |
| 1767 | 16 | 4 | 1 | 0 | 0 | 794 | 1155 |
| 1630 | 15 | 3 | 1 | 0 | 1 | 867 | 1110 |
| 1680 | 17 | 4 | 1 | 0 | 1 | 750 | 1139 |
| 1500 | 15 | 4 | 1 | 0 | 0 | 743 | 995 |
| 1400 | 16 | 2 | 1 | 0 | 1 | 731 | 900 |
| 1573 | 17 | 6 | 1 | 0 | 0 | 768 | 960 |
| 2931 | 28 | 3 | 1 | 0 | 1 | 1142 | 1695 |
| 2200 | 28 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1035 | 1553 |
| 1478 | 53 | 3 | 1 | 0 | 1 | 626 | 1020 |

| | | | | | | | |
|------|----|---|---|---|---|-------|------|
| 1713 | 30 | 4 | 1 | 0 | 1 | 600 | 1020 |
| 1190 | 41 | 1 | 1 | 0 | 0 | 600 | 850 |
| 1121 | 46 | 4 | 1 | 0 | 0 | 398 | 720 |
| 1733 | 43 | 6 | 1 | 0 | 0 | 656 | 749 |
| 2848 | 4 | 6 | 1 | 1 | 0 | 1487 | 2150 |
| 2253 | 23 | 4 | 1 | 1 | 0 | 939 | 1350 |
| 2743 | 25 | 5 | 1 | 1 | 1 | 1232 | 1299 |
| 2180 | 17 | 4 | 1 | 0 | 1 | 1141 | 1250 |
| 1706 | 14 | 4 | 1 | 0 | 0 | 810 | 1239 |
| 1710 | 16 | 4 | 1 | 1 | 0 | 800 | 1125 |
| 2200 | 26 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1076 | 1080 |
| 1680 | 13 | 4 | 1 | 0 | 0 | 875 | 1050 |
| 1900 | 34 | 3 | 1 | 0 | 0 | 690 | 1049 |
| 1543 | 20 | 3 | 1 | 0 | 0 | 820 | 934 |
| 1173 | 6 | 4 | 1 | 0 | 0 | 456 | 875 |
| 1258 | 7 | 4 | 1 | 0 | 1 | 821 | 805 |
| 997 | 4 | 4 | 1 | 0 | 0 | 461 | 759 |
| 1007 | 19 | 6 | 1 | 0 | 0 | 513 | 729 |
| 1083 | 22 | 4 | 1 | 0 | 0 | 504 | 710 |
| 1348 | 15 | 2 | 1 | 1 | 0 | -9999 | 690 |
| 1500 | 7 | 3 | 0 | 1 | 1 | 700 | 975 |
| 1428 | 40 | 2 | 0 | 0 | 0 | 701 | 939 |
| 2116 | 25 | 3 | 0 | 1 | 0 | 1209 | 2100 |
| 1051 | 15 | 2 | 0 | 0 | 0 | 426 | 580 |
| 2250 | 40 | 6 | 0 | 1 | 0 | 915 | 1844 |
| 1400 | 45 | 1 | 0 | 1 | 1 | 481 | 699 |
| 1850 | 5 | 5 | 0 | 1 | 1 | -9999 | 1330 |
| 1720 | 5 | 4 | 0 | 0 | 0 | 867 | 1160 |
| 1740 | 4 | 3 | 0 | 0 | 0 | 816 | 1109 |
| 1700 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 725 | 1129 |
| 1620 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 800 | 1050 |
| 1630 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 750 | 1045 |
| 1920 | 8 | 4 | 0 | 0 | 0 | 944 | 1050 |
| 1606 | 5 | 4 | 0 | 0 | 0 | 811 | 1020 |
| 1535 | 7 | 5 | 0 | 0 | 1 | 668 | 1000 |
| 1540 | 6 | 2 | 0 | 0 | 1 | 826 | 1030 |
| 1739 | 13 | 3 | 0 | 0 | 0 | 880 | 975 |
| 1305 | 5 | 3 | 0 | 0 | 0 | 647 | 940 |
| 1415 | 7 | 4 | 0 | 0 | 0 | 866 | 920 |
| 1580 | 9 | 3 | 0 | 0 | 0 | 810 | 945 |
| 1236 | 3 | 4 | 0 | 0 | 0 | 707 | 874 |
| 1229 | 6 | 3 | 0 | 0 | 0 | 721 | 872 |
| 1273 | 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 638 | 870 |
| 1165 | 7 | 4 | 0 | 0 | 0 | 694 | 869 |
| 1200 | 7 | 4 | 0 | 0 | 1 | 634 | 766 |
| 970 | 4 | 4 | 0 | 0 | 1 | 541 | 739 |

2. Найти коэффициент корреляции Спирмена между первой и третьей переменными (SQFT, FEATS). Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

Частная корреляция
Дана выборка

| SQFT | AGE | FEATS | NE | CUST | COR | TAX | PRICE |
|------|-----|-------|----|------|-----|-------|-------|
| 2650 | 13 | 7 | 1 | 1 | 0 | 1639 | 2050 |
| 2664 | 6 | 5 | 1 | 1 | 0 | 1193 | 2150 |
| 2921 | 3 | 6 | 1 | 1 | 0 | 1635 | 2150 |
| 2580 | 4 | 4 | 1 | 1 | 0 | 1732 | 1999 |
| 2580 | 4 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1534 | 1900 |
| 2774 | 2 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1765 | 1800 |
| 1920 | 1 | 5 | 1 | 1 | 0 | 1161 | 1560 |
| 1710 | 1 | 3 | 1 | 1 | 0 | 1010 | 1449 |
| 1837 | 4 | 5 | 1 | 0 | 0 | 1191 | 1375 |
| 1880 | 8 | 6 | 1 | 0 | 0 | 930 | 1270 |
| 2150 | 15 | 3 | 1 | 0 | 0 | 984 | 1250 |
| 1894 | 14 | 5 | 1 | 1 | 0 | 1112 | 1235 |
| 1928 | 18 | 8 | 1 | 1 | 0 | 600 | 1170 |
| 1767 | 16 | 4 | 1 | 0 | 0 | 794 | 1155 |
| 1630 | 15 | 3 | 1 | 0 | 1 | 867 | 1110 |
| 1680 | 17 | 4 | 1 | 0 | 1 | 750 | 1139 |
| 1500 | 15 | 4 | 1 | 0 | 0 | 743 | 995 |
| 1400 | 16 | 2 | 1 | 0 | 1 | 731 | 900 |
| 1573 | 17 | 6 | 1 | 0 | 0 | 768 | 960 |
| 2931 | 28 | 3 | 1 | 0 | 1 | 1142 | 1695 |
| 2200 | 28 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1035 | 1553 |
| 1478 | 53 | 3 | 1 | 0 | 1 | 626 | 1020 |
| 1713 | 30 | 4 | 1 | 0 | 1 | 600 | 1020 |
| 1190 | 41 | 1 | 1 | 0 | 0 | 600 | 850 |
| 1121 | 46 | 4 | 1 | 0 | 0 | 398 | 720 |
| 1733 | 43 | 6 | 1 | 0 | 0 | 656 | 749 |
| 2848 | 4 | 6 | 1 | 1 | 0 | 1487 | 2150 |
| 2253 | 23 | 4 | 1 | 1 | 0 | 939 | 1350 |
| 2743 | 25 | 5 | 1 | 1 | 1 | 1232 | 1299 |
| 2180 | 17 | 4 | 1 | 0 | 1 | 1141 | 1250 |
| 1706 | 14 | 4 | 1 | 0 | 0 | 810 | 1239 |
| 1710 | 16 | 4 | 1 | 1 | 0 | 800 | 1125 |
| 2200 | 26 | 4 | 1 | 0 | 0 | 1076 | 1080 |
| 1680 | 13 | 4 | 1 | 0 | 0 | 875 | 1050 |
| 1900 | 34 | 3 | 1 | 0 | 0 | 690 | 1049 |
| 1543 | 20 | 3 | 1 | 0 | 0 | 820 | 934 |
| 1173 | 6 | 4 | 1 | 0 | 0 | 456 | 875 |
| 1258 | 7 | 4 | 1 | 0 | 1 | 821 | 805 |
| 997 | 4 | 4 | 1 | 0 | 0 | 461 | 759 |
| 1007 | 19 | 6 | 1 | 0 | 0 | 513 | 729 |
| 1083 | 22 | 4 | 1 | 0 | 0 | 504 | 710 |
| 1348 | 15 | 2 | 1 | 1 | 0 | -9999 | 690 |
| 1500 | 7 | 3 | 0 | 1 | 1 | 700 | 975 |
| 1428 | 40 | 2 | 0 | 0 | 0 | 701 | 939 |
| 2116 | 25 | 3 | 0 | 1 | 0 | 1209 | 2100 |
| 1051 | 15 | 2 | 0 | 0 | 0 | 426 | 580 |
| 2250 | 40 | 6 | 0 | 1 | 0 | 915 | 1844 |

| | | | | | | | |
|------|----|---|---|---|---|-------|------|
| 1400 | 45 | 1 | 0 | 1 | 1 | 481 | 699 |
| 1850 | 5 | 5 | 0 | 1 | 1 | -9999 | 1330 |
| 1720 | 5 | 4 | 0 | 0 | 0 | 867 | 1160 |
| 1740 | 4 | 3 | 0 | 0 | 0 | 816 | 1109 |
| 1700 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 725 | 1129 |
| 1620 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 800 | 1050 |
| 1630 | 6 | 4 | 0 | 0 | 0 | 750 | 1045 |
| 1920 | 8 | 4 | 0 | 0 | 0 | 944 | 1050 |
| 1606 | 5 | 4 | 0 | 0 | 0 | 811 | 1020 |
| 1535 | 7 | 5 | 0 | 0 | 1 | 668 | 1000 |
| 1540 | 6 | 2 | 0 | 0 | 1 | 826 | 1030 |
| 1739 | 13 | 3 | 0 | 0 | 0 | 880 | 975 |
| 1305 | 5 | 3 | 0 | 0 | 0 | 647 | 940 |
| 1415 | 7 | 4 | 0 | 0 | 0 | 866 | 920 |
| 1580 | 9 | 3 | 0 | 0 | 0 | 810 | 945 |
| 1236 | 3 | 4 | 0 | 0 | 0 | 707 | 874 |
| 1229 | 6 | 3 | 0 | 0 | 0 | 721 | 872 |
| 1273 | 4 | 4 | 0 | 0 | 0 | 638 | 870 |
| 1165 | 7 | 4 | 0 | 0 | 0 | 694 | 869 |
| 1200 | 7 | 4 | 0 | 0 | 1 | 634 | 766 |
| 970 | 4 | 4 | 0 | 0 | 1 | 541 | 739 |

Найти частный коэффициент корреляции между первым и третьим признаками. Решить задачу в R и PythonStudio. Можно использовать функцию rcor. Ответ дать с точностью до трех знаков после запятой

Тема 2. Проверка гипотез и построение доверительных интервалов в модели парной линейной регрессии

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или B).

1. Установите соответствие между наименованиями элементов уравнения $y = \beta_0 + \beta_1 x + \varepsilon$ и их буквенными обозначениями:

- 1) параметры регрессии
- 2) объясняющая переменная
- 3) объясняемая переменная
- 4) случайные отклонения

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

2. Для линейного уравнения регрессии $y = \beta_0 + \beta_1 x + \varepsilon$ метод наименьших квадратов используется при оценивании параметров...

1. β_0
2. y
3. x
4. β_1

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.
2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

3. Сколько параметров содержит парное линейное уравнение регрессии?

1. 1
2. 2
3. 3
4. 4

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.
2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

4. При выполнении предпосылок МНК оценки параметров регрессии обладают свойствами:

1. достоверность
2. эффективность
3. несмещенность
4. несостоятельность

ПКЗ по теме 2:

Все тексты домашних заданий размещены на отдельных листах файлов в Excel. Файлы с домашними заданиями находятся в Ресурсах сети в папке, соответствующей учебной группе, а также в СДО института.

1. Парная регрессия. Пример задачи

| Year | People |
|------|--------|
| 1959 | 117,5 |
| 1970 | 129,9 |
| 1979 | 137,4 |
| 1989 | 147 |
| 1992 | 148,3 |
| 1993 | 148,3 |
| 1994 | 148 |
| 1995 | 147,9 |
| 2002 | 145,2 |

- Построить график зависимости
- С помощью линии тренда определить линейное уравнение регрессии
- Спрогнозировать значение численности населения через 2 года
- Оценить качество уравнения регрессии
- Проверить выполнение ограничений Гаусса-Маркова
- Исследовать корреляцию факторов между собой, корреляцию факторов с откликом

- Построить модель множественной регрессии.
- Оценить качество модели по статистическим критериям, а также по физической интерпретации
- Построить графики зависимости ошибок от факторов и от отклика.

-

- 2. Коэффициенты парной линейной регрессии

- Чему равен коэффициент b_0 выборочной парной линейной регрессионной модели, определяющей зависимость тормозного пути автомобиля от скорости для данных, которые были записаны в 1920 году (Ezekiel, M. (1930) *Methods of Correlation Analysis*. Wiley.) Набор данных находится в файле cars {datasets}? Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

-

- 3. Критерий Фишера

- Если наблюдаемое значение критерия Фишера равно 3,4 при числе степеней свободы 23 и 2, что можно сказать об адекватности модели по данному критерию? Указать значение уровня значимости p-value. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой.

-

- 4. Чему равна медиана остатков при построении модели парной линейной регрессии зависимости веса взрослых американских женщин от роста, если данные находятся в пакете datasets R. Набор данных имеет имя women. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

5. Исправленное значение коэффициента детерминации

- Чему равно исправленное значение коэффициента детерминации для парной линейной модели, прогнозирования объема древесины от высоты дерева для набора данных trees {datasets}. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

6. Коэффициент детерминации

Для уравнения зависимости спроса на товар от цены на единицу товара построена парная линейная регрессионная модель. Получено значение коэффициента детерминации, равное 0,64. Чему равен коэффициент корреляции между предиктором и откликом: Ответ дать с точностью до одного знака после запятой

Тема 3. Модель множественной линейной регрессии.

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

1. Примерами фиктивных переменных могут служить:

1. образование

2. доход

3. возраст

4. пол

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

2. Коэффициент детерминации рассчитывается для ...

1. Оценки качества модели

2. мультиколлинеарных факторов

3. подбора уравнения регрессии

4. оценки параметров уравнения регрессии

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

3. Под мультиколлинеарностью понимают:

1. Наличие ярко выраженной линейной корреляционной зависимости между факторами.
2. Наличие в уравнении регрессии неоправданно большого числа факторов.
3. Наличие в уравнении регрессии большого числа незначимых параметров.
4. Наличие в уравнении стохастических регрессоров.

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

4. Обобщенный МНК применяют в случае:

1. Наличие гомоскедастичности.
2. Наличие гетероскедастичности.
3. При автокорреляции ошибок.
4. Только при рассмотрении систем уравнений.

ПКЗ по теме 3:

1. Множественная линейная регрессия. Пример задачи

| Общая площадь (x1) | Количество офисов (x2) | Количество входов (x3) | Время эксплуатации (x4) | Оценочная цена (y) |
|--------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|--------------------|
| 2310 | 2 | 2 | 20 | 142 000 |
| 2333 | 2 | 2 | 12 | 144 000 |
| 2356 | 3 | 1,5 | 33 | 151 000 |
| 2379 | 3 | 2 | 43 | 150 000 |
| 2402 | 2 | 3 | 53 | 139 000 |
| 2425 | 4 | 2 | 23 | 169 000 |
| 2448 | 2 | 1,5 | 99 | 126 000 |
| 2471 | 2 | 2 | 34 | 142 900 |
| 2494 | 3 | 3 | 23 | 163 000 |
| 2517 | 4 | 4 | 55 | 169 000 |
| 2540 | 2 | 3 | 22 | 149 000 |

Расчетное задание

Расчетно-графическое задание посвящено построению выборочной линейной множественной регрессионной модели по данным о пятидесяти промышленных предприятий. В выборку входят 12 предикторов, характеризующих деятельность предприятия. К ним относятся: финансовые показатели (фонд зарплаты, фондоотдача, непроизводственные расходы, фондовооруженность труда, фондоотдача и др.), данные о трудовом ресурсе предприятия (среднегодовая численность работников, удельный вес рабочих и др.) и некоторые другие показатели. В качестве зависимых переменных выступают: производительность труда, индекс снижения себестоимости

продукции, рентабельность.

Данная выборка позволяет решить задачи эконометрического моделирования, построить систему эконометрических уравнений или отдельные уравнения. В расчетном задании необходимо построить и проверить качество одной выборочной регрессионной модели. Исходные данные, для которых решается задача построения такой модели определяется вариантом задания. Каждый вариант определяет одну зависимую переменную и шесть независимых переменных. Так данные, включенные в каждый вариант, выбраны случайным образом, то возможно, модель, построенная по заданным исходным данным, не позволит построить адекватную модель, описывающую поведение зависимой переменной. В этом случае, студент может дополнительно включить в модель другие предикторы.

Для решения задачи построения множественной линейной регрессионной модели следует использовать excel, статистический пакет JASP, а также языки аналитики R и Python.

При построении модели следует решить следующие частные задачи:

- выполнить разведочный контроль исходных данных;
- построить регрессионные модели для всех предикторов с помощью указанных инструментальных средств;
- проверить качество построенных моделей;
- решить задачу пошагового построения модели;
- оценить качество итоговой модели и сделать выводы по результатам эконометрического моделирования.

Решение данных задач определяет структуру отчета по выполненному расчетному заданию.

2. Доверительный интервал. Данные заданы таблицей

| Year | X | Y | Z |
|------|-------|--------|-------|
| 1964 | 28,4 | 635,7 | 92,9 |
| 1965 | 32 | 688,1 | 94,5 |
| 1966 | 37,7 | 753 | 97,2 |
| 1967 | 40,6 | 796,3 | 100 |
| 1968 | 47,7 | 868,5 | 104,2 |
| 1969 | 52,9 | 935,5 | 109,8 |
| 1970 | 58,5 | 982,4 | 116,3 |
| 1971 | 64 | 1063,4 | 121,3 |
| 1972 | 75,9 | 1171,1 | 125,4 |
| 1973 | 94,4 | 1306,6 | 133,1 |
| 1974 | 131,9 | 1412,9 | 137,7 |
| 1975 | 126,9 | 1528,8 | 161,2 |
| 1976 | 155,4 | 1702,2 | 170,5 |
| 1977 | 185,8 | 1899,5 | 181,5 |
| 1978 | 217,5 | 2127,6 | 195,4 |
| 1979 | 260,9 | 2368,5 | 217,4 |

Найти левую границу доверительного интервала для оценки прогнозируемого значения отклика Z если известны значения предикторов

множественной линейной регрессионной модели $X=35$, $Y=630$. Ответ дать целым числом

3. Информационный критерий

Чему равно значение информационного критерия Акайке для множественной линейной регрессии, позволяющей прогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от его высоты и обхвата для набора данных $trees\{datasets\}$

4. Коэффициент детерминации

Чему равен коэффициент детерминации для множественной линейной регрессионной модели, позволяющей спрогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от обхвата и высоты для набора данных $trees\{datasets\}$. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

5. Критерий Фишера

Чему равно наблюдаемое значение критерия Фишера для множественной линейной регрессионной модели, позволяющей спрогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от обхвата и высоты для набора данных $trees\{datasets\}$. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

Тема 4. Гетероскедастичность, автокоррелированность и мультиколлинеарность

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или B).

1. Примерами фиктивных переменных могут служить:

5. образование

6. доход

7. возраст

8. пол

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

2. Коэффициент детерминации рассчитывается для ...

5. Оценки качества модели
6. мультиколлинеарных факторов
7. подбора уравнения регрессии
8. оценки параметров уравнения регрессии

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

3. Под мультиколлинеарностью понимают:

5. Наличие ярко выраженной линейной корреляционной зависимости между факторами.
6. Наличие в уравнении регрессии неоправданно большого числа факторов.
7. Наличие в уравнении регрессии большого числа незначимых параметров.
8. Наличие в уравнении стохастических регрессоров.

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

4. Обобщенный МНК применяют в случае:

5. Наличие гомоскедастичности.
6. Наличие гетероскедастичности.
7. При автокорреляции ошибок.
8. Только при рассмотрении систем уравнений.

ПКЗ по теме 4:

1. Множественная линейная регрессия. Пример задачи

| Общая площадь (x1) | Количество офисов (x2) | Количество входов (x3) | Время эксплуатации (x4) | Оценочная цена (y) |
|--------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|--------------------|
| 2310 | 2 | 2 | 20 | 142 000 |
| 2333 | 2 | 2 | 12 | 144 000 |
| 2356 | 3 | 1,5 | 33 | 151 000 |
| 2379 | 3 | 2 | 43 | 150 000 |
| 2402 | 2 | 3 | 53 | 139 000 |
| 2425 | 4 | 2 | 23 | 169 000 |
| 2448 | 2 | 1,5 | 99 | 126 000 |

| | | | | |
|------|---|---|----|---------|
| 2471 | 2 | 2 | 34 | 142 900 |
| 2494 | 3 | 3 | 23 | 163 000 |
| 2517 | 4 | 4 | 55 | 169 000 |
| 2540 | 2 | 3 | 22 | 149 000 |

Расчетное задание

Расчетно-графическое задание посвящено построению выборочной линейной множественной регрессионной модели по данным о пятидесяти промышленных предприятий. В выборку входят 12 предикторов, характеризующих деятельность предприятия. К ним относятся: финансовые показатели (фонд зарплаты, фондоотдача, непроизводственные расходы, фондовооруженность труда, фондоотдача и др.), данные о трудовом ресурсе предприятия (среднегодовая численность работников, удельный вес рабочих и др.) и некоторые другие показатели. В качестве зависимых переменных выступают: производительность труда, индекс снижения себестоимости продукции, рентабельность.

Данная выборка позволяет решить задачи эконометрического моделирования, построить систему эконометрических уравнений или отдельные уравнения. В расчетном задании необходимо построить и проверить качество одной выборочной регрессионной модели. Исходные данные, для которых решается задача построения такой модели определяется вариантом задания. Каждый вариант определяет одну зависимую переменную и шесть независимых переменных. Так данные, включенные в каждый вариант, выбраны случайным образом, то возможно, модель, построенная по заданным исходным данным, не позволит построить адекватную модель, описывающую поведение зависимой переменной. В этом случае, студент может дополнительно включить в модель другие предикторы.

Для решения задачи построения множественной линейной регрессионной модели следует использовать excel, статистический пакет JASP, а также языки аналитики R и Python.

При построении модели следует решить следующие частные задачи:

- выполнить разведочный контроль исходных данных;
- построить регрессионные модели для всех предикторов с помощью указанных инструментальных средств;
- проверить качество построенных моделей;
- решить задачу пошагового построения модели;
- оценить качество итоговой модели и сделать выводы по результатам эконометрического моделирования.

Решение данных задач определяет структуру отчета по выполненному расчетному заданию.

2. Доверительный интервал. Данные заданы таблицей

| Year | X | Y | Z |
|------|------|-------|------|
| 1964 | 28,4 | 635,7 | 92,9 |
| 1965 | 32 | 688,1 | 94,5 |
| 1966 | 37,7 | 753 | 97,2 |

| | | | |
|------|-------|--------|-------|
| 1967 | 40,6 | 796,3 | 100 |
| 1968 | 47,7 | 868,5 | 104,2 |
| 1969 | 52,9 | 935,5 | 109,8 |
| 1970 | 58,5 | 982,4 | 116,3 |
| 1971 | 64 | 1063,4 | 121,3 |
| 1972 | 75,9 | 1171,1 | 125,4 |
| 1973 | 94,4 | 1306,6 | 133,1 |
| 1974 | 131,9 | 1412,9 | 137,7 |
| 1975 | 126,9 | 1528,8 | 161,2 |
| 1976 | 155,4 | 1702,2 | 170,5 |
| 1977 | 185,8 | 1899,5 | 181,5 |
| 1978 | 217,5 | 2127,6 | 195,4 |
| 1979 | 260,9 | 2368,5 | 217,4 |

Найти левую границу доверительного интервала для оценки прогнозируемого значения отклика Z если известны значения предикторов множественной линейной регрессионной модели $X=35$, $Y=630$. Ответ дать целым числом

3. Информационный критерий

Чему равно значение информационного критерия Акайке для множественной линейной регрессии, позволяющей прогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от его высоты и обхвата для набора данных `trees {datasets}`

4. Коэффициент детерминации

Чему равен коэффициент детерминации для множественной линейной регрессионной модели, позволяющей спрогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от обхвата и высоты для набора данных `trees {datasets}`. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

5. Критерий Фишера

Чему равно наблюдаемое значение критерия Фишера для множественной линейной регрессионной модели, позволяющей спрогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от обхвата и высоты для набора данных `trees {datasets}`. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

Тема 5. Источники смещения оценок МНК

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

1. Примерами фиктивных переменных могут служить:

9. образование

10. доход

11. возраст

12. пол

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

2. Коэффициент детерминации рассчитывается для ...

9. Оценки качества модели

10. мультиколлинеарных факторов

11. подбора уравнения регрессии

12. оценки параметров уравнения регрессии

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

3. Под мультиколлинеарностью понимают:

9. Наличие ярко выраженной линейной корреляционной зависимости между факторами.

10. Наличие в уравнении регрессии неоправданно большого числа факторов.

11. Наличие в уравнении регрессии большого числа незначимых параметров.

12. Наличие в уравнении стохастических регрессоров.

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа

(например, 3 или В).

4. Обобщенный МНК применяют в случае:

9. Наличие гомоскедастичности.
10. Наличие гетероскедастичности.
11. При автокорреляции ошибок.
12. Только при рассмотрении систем уравнений.

ПКЗ по теме 5:

1. Множественная линейная регрессия. Пример задачи

| Общая площадь (x1) | Количество офисов (x2) | Количество входов (x3) | Время эксплуатации (x4) | Оценочная цена (y) |
|--------------------|------------------------|------------------------|-------------------------|--------------------|
| 2310 | 2 | 2 | 20 | 142 000 |
| 2333 | 2 | 2 | 12 | 144 000 |
| 2356 | 3 | 1,5 | 33 | 151 000 |
| 2379 | 3 | 2 | 43 | 150 000 |
| 2402 | 2 | 3 | 53 | 139 000 |
| 2425 | 4 | 2 | 23 | 169 000 |
| 2448 | 2 | 1,5 | 99 | 126 000 |
| 2471 | 2 | 2 | 34 | 142 900 |
| 2494 | 3 | 3 | 23 | 163 000 |
| 2517 | 4 | 4 | 55 | 169 000 |
| 2540 | 2 | 3 | 22 | 149 000 |

Расчетное задание

Расчетно-графическое задание посвящено построению выборочной линейной множественной регрессионной модели по данным о пятидесяти промышленных предприятий. В выборку входят 12 предикторов, характеризующих деятельность предприятия. К ним относятся: финансовые показатели (фонд зарплаты, фондоотдача, непроизводственные расходы, фондовооруженность труда, фондоотдача и др.), данные о трудовом ресурсе предприятия (среднегодовая численность работников, удельный вес рабочих и др.) и некоторые другие показатели. В качестве зависимых переменных выступают: производительность труда, индекс снижения себестоимости продукции, рентабельность.

Данная выборка позволяет решить задачи эконометрического моделирования, построить систему эконометрических уравнений или отдельные уравнения. В расчетном задании необходимо построить и проверить качество одной выборочной регрессионной модели. Исходные данные, для которых решается задача построения такой модели определяется вариантом задания. Каждый вариант определяет одну зависимую переменную и шесть независимых переменных. Так данные, включенные в каждый вариант, выбраны случайным образом, то возможно, модель, построенная по заданным исходным данным, не позволит построить адекватную модель, описывающую поведение зависимой переменной. В этом случае, студент может дополнительно включить в модель другие предикторы.

Для решения задачи построения множественной линейной регрессионной модели следует использовать excel, статистический пакет JASP, а также языки аналитики R и Python.

При построении модели следует решить следующие частные задачи:

- выполнить разведочный контроль исходных данных;

-построить регрессионные модели для всех предикторов с помощью указанных инструментальных средств;

- проверить качество построенных моделей;

-решить задачу пошагового построения модели;

-оценить качество итоговой модели и сделать выводы по результатам эконометрического моделирования.

Решение данных задач определяет структуру отчета по выполненному расчетному заданию.

2.Доверительный интервал. Данные заданы таблицей

| Year | X | Y | Z |
|------|-------|--------|-------|
| 1964 | 28,4 | 635,7 | 92,9 |
| 1965 | 32 | 688,1 | 94,5 |
| 1966 | 37,7 | 753 | 97,2 |
| 1967 | 40,6 | 796,3 | 100 |
| 1968 | 47,7 | 868,5 | 104,2 |
| 1969 | 52,9 | 935,5 | 109,8 |
| 1970 | 58,5 | 982,4 | 116,3 |
| 1971 | 64 | 1063,4 | 121,3 |
| 1972 | 75,9 | 1171,1 | 125,4 |
| 1973 | 94,4 | 1306,6 | 133,1 |
| 1974 | 131,9 | 1412,9 | 137,7 |
| 1975 | 126,9 | 1528,8 | 161,2 |
| 1976 | 155,4 | 1702,2 | 170,5 |
| 1977 | 185,8 | 1899,5 | 181,5 |
| 1978 | 217,5 | 2127,6 | 195,4 |
| 1979 | 260,9 | 2368,5 | 217,4 |

Найти левую границу доверительного интервала для оценки прогнозируемого значения отклика Z если известны значения предикторов множественной линейной регрессионной модели $X=35$, $Y=630$. Ответ дать целым числом

3.Информационный критерий

Чему равно значение информационного критерия Акайке для множественной линейной регрессии, позволяющей прогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от его высоты и обхвата для набора данных `trees {datasets}`

4.Коэффициент детерминации

Чему равен коэффициент детерминации для множественной линейной регрессионной модели, позволяющей спрогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от обхвата и высоты для набора данных `trees {datasets}`. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

5.Критерий Фишера

Чему равно наблюдаемое значение критерия Фишера для множественной линейной регрессионной модели, позволяющей спрогнозировать объем древесины срубленного дерева черной вишни от обхвата и высоты для набора данных `trees{datasets}`. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

Тема 6. Нелинейные регрессионные модели

Тестовые задания:

Задание открытого типа с написанием правильного ответа.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внести верный ответ в поле ответа.

3. Записать значение цифрами, если в ответе вещественное число, целую часть от дробной отделить точкой, или запятой.

1. Выборка имеет вид

| Среднемесячный доход семьи, \$, | Процент расходов на товары длительного пользования, |
|---------------------------------|---|
| 1000 | 10 |
| 2000 | 13,4 |
| 3000 | 15,4 |
| 4000 | 16,5 |
| 5000 | 18,6 |
| 6000 | 18,9 |

С помощью замены предиктора на обратную величину, построить парную линейную модель. Укажите значение критерия Стьюдента при проверке значимости коэффициента b_0 . Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

Задание открытого типа с написанием правильного ответа.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внести верный ответ в поле ответа.

3. Записать значение цифрами, если в ответе вещественное число, целую часть от дробной отделить точкой, или запятой.

2. Кубическая модель

Даны две последовательности: $x \leftarrow \text{seq}(1, 8)$; $y \leftarrow c(81, 112, 132, 147, 154, 152, 138, 142)$. Для оценки значения коэффициентов кубической модели зависимости y от x с помощью функции `pls` заданы начальные значения коэффициентов 20, 1, 1, 0.1.

Определить уровень значимости коэффициента при x^3 . Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой

Задание открытого типа с написанием правильного ответа.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внести верный ответ в поле ответа.

3. Записать значение цифрами, если в ответе вещественное число, целую часть от дробной отделить точкой, или запятой.

3.Полиномиальная модель

Заданы две последовательности $x \leftarrow \text{seq}(1,12)$; $y \leftarrow c(81,112,132,147,154,152,138,122,129,143,145,148)$.

Выберите порядок полинома. И подтвердите свой выбор указанием значения информационного критерия Акайке . Его значение введите с точностью до целых. Порядок проверяемого полинома ограничить полиномом четвертого порядка

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1.Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или B).

4. Эластичность

Укажите верные характеристики коэффициента эластичности

По значению коэффициента эластичности можно судить о силе линейной связи объясняющего фактора с результирующим

1. Коэффициент эластичности является постоянной величиной для всех видов полиномиальных моделей
2. коэффициент эластичности показывает на сколько изменится значение результирующего фактора при изменении объясняющего фактора на одну единицу
3. коэффициент эластичности показывает на сколько процентов изменится значение результирующего фактора при изменении на один процент объясняющего фактора
4. коэффициент эластичности показывает на сколько единиц изменится значение результирующего фактора при изменении на один процент объясняющего фактора
5. Коэффициент эластичности постоянен для степенной модели

Задание открытого типа с написанием правильного ответа.

1.Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внести верный ответ в поле ответа.

3. Записать значение цифрами, если в ответе вещественное число, целую часть от дробной отделить точкой, или запятой.

5. Гиперболическая модель

Выборка имеет вид

| | |
|---------------------------------|---|
| Среднемесячный доход семьи, \$, | Процент расходов на товары длительного пользования, |
|---------------------------------|---|

| | |
|------|------|
| 1000 | 10 |
| 2000 | 13,4 |
| 3000 | 15,4 |
| 4000 | 16,5 |
| 5000 | 18,6 |
| 6000 | 18,9 |

С помощью замены предиктора на обратную величину, построить парную линейную модель. Чему равно наблюдаемое значение критерия R^2 . Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой.

Задание открытого типа с написанием правильного ответа.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внести верный ответ в поле ответа.

3. Записать значение цифрами, если в ответе вещественное число, целую часть от дробной отделить точкой, или запятой.

6. Уровни значимости модели

На основе имеемых данных, заданных последовательностями $x \leftarrow \text{seq}(1,8)$; $y \leftarrow c(81,112,132,147,154,152,138,142)$ построена полиномиальная модель второго порядка. Поставьте соответствие вычисленному коэффициенту уровень его значимости при проверке статистической гипотезы по критерию Стьюдента b_0, b_1, b_2

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или B).

7. Диаграмма рассеяния указывает на нелинейную зависимость. В этом случае следует осуществить ...

1. подбор преобразования переменных, дающего наибольшее по абсолютной величине значение коэффициента парной корреляции

2. включение в модель дополнительных факторных признаков

3. расчет линейного коэффициента корреляции и использование линейной модели

4. визуальный подбор функциональной зависимости нелинейного характера, соответствующего структуре точечного графика

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

8.Примером нелинейной зависимости экономических показателей является ...

1. классическая гиперболическая зависимость спроса от цены
2. линейная зависимость выручки от величины оборотных средств
3. линейная зависимость затрат на производство от объема выпуска продукции
4. зависимость объема продаж от недели реализации, выраженная линейным трендом

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1.Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

9.Установите соответствие между названием модели и видом ее уравнения:

- А. линейная
- В. полиномиальная
- С. показательная
- Д. полулогарифмическая

варианты ответов:

- 1) $y = \beta_0 \cdot \ln x \cdot \varepsilon$
- 2) $y = \beta_0 + \beta_1 x + \varepsilon$
- 3) $y = \beta_0 \cdot \beta_1^x \cdot \varepsilon$
- 4) $y = \beta_0 + \beta_1 x + \beta_2 x^2 + \varepsilon$

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1.Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

10 Установите соответствие между видом нелинейной модели и заменой переменных, сводящих ее к линейной регрессии.

1. $y = \beta_0 + \beta_1 x + \beta_2 x^2 + \varepsilon$
2. $y = \beta_0 \cdot x^{\beta_1} \cdot \varepsilon$
3. $y = \beta_0 \cdot \beta_1^x \cdot \varepsilon$
4. $y = 1 / (\beta_0 + \beta_1 x + \varepsilon)$

ПКЗ по теме 6:

1. Нелинейная регрессия. Пример задачи

| t | Y1(t) |
|----|-------|
| 1 | 5,62 |
| 2 | 5,66 |
| 3 | 4,66 |
| 4 | 6,02 |
| 5 | 5,34 |
| 6 | 6,19 |
| 7 | 6,60 |
| 8 | 6,57 |
| 9 | 6,72 |
| 10 | 7,51 |
| 11 | 7,32 |
| 12 | 7,21 |
| 13 | 8,08 |
| 14 | 7,67 |
| 15 | 7,87 |
| 16 | 8,35 |

- 1 Построить гиперболическую модель
- 2 Оценить качество модели
- 3 Построить полиномиальную модель, используя полином первого, второго и третьего порядков
- 4 С помощью информационных критериев сравнить полиномиальные модели
5. Построить диаграммы зависимости $y=f(x)$. Построить линии тренда для данных диаграмм. Сравнить результаты расчетов с параметрами трендов

Тема 7. Модели временных рядов

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

1. Автокоррелированность остатков

С помощью какого критерия проверяется автокоррелированность остатков?

1. Дарбина-Ватсона
2. Колмогорова-Смирнова
3. Лилиельфорса
4. Дики-Фуллера
5. Брауша-Пагана

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

2. Аномальные наблюдения

Пространственная выборка задана двумя последовательностями:

$x \sim \text{seq}(1, 12)$

$y \sim \text{c}(81, 112, 132, 147, 124, 122, 138, 122, 129, 143, 145, 143)$

Построена парная линейная модель зависимости y от x . Указать номера аномальных наблюдений, если такие имеются. Для анализа аномалий можно использовать ящичную диаграмму

1. нет аномальных наблюдений
2. 1
3. 2
4. 3
5. 4
6. 5
7. 6
8. 7

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

4. Влиятельное наблюдение

Что означает влиятельное наблюдение?

1. наблюдение оказывает непропорциональное влияние на значения параметров модели
2. Для наблюдения характерно максимальное значение остатка
3. Стандартизированное значение остатка по абсолютной величине превышает 3
4. наблюдение максимально удалено от центра распределения значений предикторов
5. остаток для данного наблюдения максимально удален от центра распределения отсчетов

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

5. Гетероскедастичность подразумевает

1. постоянство дисперсии случайной составляющей
2. непостоянство дисперсии случайной составляющей
3. непостоянство дисперсии факторов
4. некоррелированность остатков

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

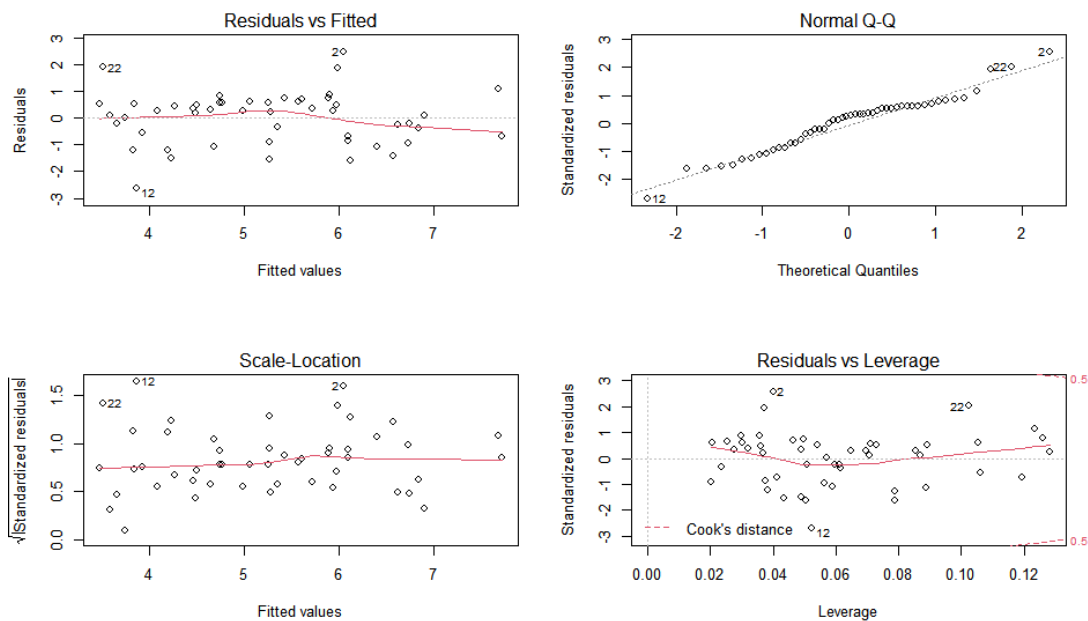
2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

6. Графическая проверка качества модели

В результате графической проверки качества построенной линейной модели получена матричная диаграмма, приведенная на рисунке.



Какие выводы можно сделать по качеству модели?

1. Остатки гомоскедастичны
2. Остатки гетероскедастичны
3. Остатки подчинены нормальному закону распределения
4. Остатки не подчинены нормальному закону распределения
5. Зависимая и независимые переменные связаны между собой линейно
6. Нет влиятельных наблюдений, для которых расстояние Кука превышает пороговые значения

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

7. Критерий гетероскедастичности

С помощью каких статистических критериев проверяют гетероскедастичность модели?

1. Дики-Фуллера
2. Дарбина-Ватсона
3. Гольдфелда-Квандта
4. Брауша-Пагана
5. Кайзера

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

8. Способы борьбы с гетероскедастичностью

Выберите возможные способы борьбы с гетероскедастичностью

1. использование обобщенного метода наименьших квадратов

2. использование взвешенного метода наименьших квадратов

3. использование двухшагового метода наименьших квадратов

4. использование метода наименьших модулей

5. использование метода частичных наименьших квадратов

ПКЗ по теме 7:

1. Проблемы гетероскедастичности и автокоррелированности остатков.

Пример задачи

| X | Y |
|----|-------|
| 1 | 36,34 |
| 2 | 37,02 |
| 3 | 37,72 |
| 4 | 38,76 |
| 5 | 39,54 |
| 6 | 40,31 |
| 7 | 40,62 |
| 8 | 41,60 |
| 9 | 43,41 |
| 10 | 44,30 |
| 11 | 44,82 |
| 12 | 46,31 |
| 13 | 46,11 |
| 14 | 47,44 |
| 15 | 49,08 |
| 16 | 47,22 |
| 17 | 49,77 |
| 18 | 48,33 |
| 19 | 52,58 |
| 20 | 51,06 |
| 21 | 53,63 |
| 22 | 51,27 |
| 23 | 52,41 |
| 24 | 55,53 |
| 25 | 55,07 |
| 26 | 57,79 |
| 27 | 57,18 |

1 Проверить гетероскедастичность с помощью критерия Спирмена

2 Проверить гетероскедастичность с помощью критерия Готфельда-Квандта

3 Проверить автокорреляцию остатков с помощью критерия Дарбина-Ватсона

Тема 8. Прочие модели (обзор)

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.
2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

1. Автокоррелированность остатков

С помощью какого критерия проверяется автокоррелированность остатков?

6. Дарбина-Ватсона
7. Колмогорова-Смирнова
8. Лилиельфорса
9. Дики-Фуллера
10. Брауша-Пагана

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.
2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.
3. Выбрать один верный ответ.
4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

2. Аномальные наблюдения

Пространственная выборка задана двумя последовательностями:

$x \leftarrow \text{seq}(1, 12)$

$y \leftarrow \text{c}(81, 112, 132, 147, 124, 122, 138, 122, 129, 143, 145, 143)$

Построена парная линейная модель зависимости y от x . Указать номера аномальных наблюдений, если такие имеются. Для анализа аномалий можно использовать ящичную диаграмму

9. нет аномальных наблюдений

10.1

11.2

12.3

13.4

14.5

15.6

16.7

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

4. Влиятельное наблюдение

Что означает влиятельное наблюдение?

6. наблюдение оказывает непропорциональное влияние на значения параметров модели

7. Для наблюдения характерно максимальное значение остатка

8. Стандартизированное значение остатка по абсолютной величине превышает 3

9. наблюдение максимально удалено от центра распределения значений предикторов

10. остаток для данного наблюдения максимально удален от центра распределения отстатков

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

5. Гетероскедастичность подразумевает

5. постоянство дисперсии случайной составляющей

6. непостоянство дисперсии случайной составляющей

7. непостоянство дисперсии факторов

8. некоррелированность остатков

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

7. Критерий гетероскедастичности

С помощью каких статистических критериев проверяют гетероскедастичность модели?

6. Дики-Фуллера

7. Дарбина-Ватсона

8. Гольдфелда-Квандта

9. Брауша-Пагана

10. Кайзера

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

8. Способы борьбы с гетероскедастичностью

Выберите возможные способы борьбы с гетероскедастичностью

6. использование обобщенного метода наименьших квадратов

7. использование взвешенного метода наименьших квадратов

8. использование двухшагового метода наименьших квадратов

9. использование метода наименьших модулей

10. использование метода частичных наименьших квадратов

ПКЗ по теме 8:

1. Проблемы гетероскедастичности и автокоррелированности остатков.
Пример задачи

| X | Y |
|----|-------|
| 1 | 36,34 |
| 2 | 37,02 |
| 3 | 37,72 |
| 4 | 38,76 |
| 5 | 39,54 |
| 6 | 40,31 |
| 7 | 40,62 |
| 8 | 41,60 |
| 9 | 43,41 |
| 10 | 44,30 |
| 11 | 44,82 |
| 12 | 46,31 |
| 13 | 46,11 |
| 14 | 47,44 |
| 15 | 49,08 |
| 16 | 47,22 |
| 17 | 49,77 |
| 18 | 48,33 |
| 19 | 52,58 |
| 20 | 51,06 |
| 21 | 53,63 |
| 22 | 51,27 |
| 23 | 52,41 |
| 24 | 55,53 |
| 25 | 55,07 |
| 26 | 57,79 |
| 27 | 57,18 |

- 1 Проверить гетероскедастичность с помощью критерия Спирмена
- 2 Проверить гетероскедастичность с помощью критерия Готфельда-Квандта
- 3 Проверить автокорреляцию остатков с помощью критерия Дарбина-Ватсона

Тема 6. Системы линейных одновременных уравнений.

Тестовые задания:

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные вариант-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

1. Двухшаговый метод наименьших квадратов. Расставьте номера шагов косвенного метода наименьших квадратов

1. Построить систему в структурной форме

2. Получить приведенную форму системы одновременных уравнений

3. Оценить коэффициенты уравнений в приведенной форме

4. Рассчитать коэффициенты в структурной форме системы одновременных уравнений

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

2. Проблема идентифицируемости. Известно, что в системе одновременных уравнений имеется 3 эндогенных и 2 экзогенных (предопределенных) переменных. В анализируемом уравнении известно число экзогенных n и число эндогенных m переменных. Поставьте соответствие между этими значениями и типом уравнения

A. $n=1; m=1$

B. $n=2, m=2$

C. $n=0, m=2$

D. $n=1, m=2$

Варианты ответов:

1. -уравнение идентифицируемо;

2. -уравнение не идентифицируемо;

3. -уравнение сверхидентифицируемо.

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

3. Системы эконометрических уравнений

Поставьте соответствие системам их класс и форму

1. $y_1 = a_{12}y_2 + b_{11}x_1 + \text{eps}_1$
 $y_2 = a_{21}y_1 + b_{22}x_2 + \text{eps}_2$

2. $y_1 = a_{12}y_2 + b_{11}x_1 + \text{eps}_1$
 $y_2 = b_{20} + b_{22}x_2 + \text{eps}_2$

3. $y_1 = a_{12}x_2 + b_{11}x_1 + \text{eps}_1$
 $y_2 = a_{21}x_1 + b_{22}x_2 + \text{eps}_2$

Варианты ответов:

- А. -система независимых уравнений;
- В. -система рекурсивных уравнений;
- С. -структурная система одновременных уравнений.

Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных.

1. Внимательно прочитайте текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.

2. Внимательно прочитайте предложенные варианты-ты ответа.

3. Выбрать один верный ответ.

4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или В).

4. Сверхидентифицируемые системы одновременных уравнений

Пусть система одновременных уравнений сверхидентифицируема. Как найти ее коэффициенты?

1. Классическим методом наименьших квадратов

2. Косвенным методом наименьших квадратов

3. Выполнить ее приведение к приведенной форме и решить каждое из уравнений классическим методом наименьших квадратов

4. Двухшаговым методом наименьших квадратов

5. Трехшаговым методом наименьших квадратов

ПКЗ по теме 8:

1. Системы одновременных уравнений. Пример задачи

| Y | C | I |
|---------|---------|--------|
| 950,51 | 700,51 | 250,00 |
| 961,76 | 699,26 | 262,50 |
| 841,19 | 565,56 | 275,63 |
| 1282,80 | 993,39 | 289,41 |
| 1105,53 | 801,66 | 303,88 |
| 1171,23 | 852,16 | 319,07 |
| 1343,51 | 1008,49 | 335,02 |
| 1356,85 | 1005,07 | 351,78 |
| 1261,27 | 891,90 | 369,36 |
| 1502,97 | 1115,14 | 387,83 |
| 1380,12 | 972,90 | 407,22 |
| 1605,49 | 1177,90 | 427,58 |
| 1671,77 | 1222,80 | 448,96 |
| 1615,60 | 1144,19 | 471,41 |
| 1787,21 | 1292,22 | 494,98 |
| 1721,50 | 1201,77 | 519,73 |
| 1787,45 | 1241,73 | 545,72 |
| 1985,28 | 1412,27 | 573,00 |
| 2059,61 | 1457,95 | 601,65 |
| 2266,38 | 1634,64 | 631,74 |

1. Построить систему одновременных уравнений косвенным методом наименьших квадратов.

5.2. Типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости

обучающихся (вне контрольных точек):
приведены в п.6.2.

5.3. Один или несколько тематических блоков дисциплины завершаются контрольной точкой (далее – КТ). Текущий контроль успеваемости по дисциплине предусматривает не менее 2 (двух) и не более 10 (десяти) КТ в течение периода освоения дисциплины.

Максимальное количество баллов за любой тип работ в рамках КТ составляет 100 (сто) баллов.

Распределение весовых коэффициентов по КТ в рамках текущего контроля успеваемости по дисциплине и формулы расчета:

| Наименование контрольной точки | Максимальное количество баллов за работу в рамках КТ, которое может набрать студент | Коэффициент веса контрольной точки | Результат контрольной точки, участвующий в формировании итоговой балльной оценки по дисциплине (отражается в журнале БРС в СДО) |
|--------------------------------|---|------------------------------------|---|
| КТ - 1 | 100 | 0,18 | 18 |
| КТ - 2 | 100 | 0,12 | 12 |
| КТ- 3 | 100 | 0,15 | 15 |
| КТ - 4 | 100 | 0,15 | 15 |
| Итого: | x | 0,6 | 60 |

Формула расчета результата контрольной точки:

Результат контрольной точки = Количество баллов за работу в рамках КТ X Коэффициент веса контрольной точки.

5.4. Формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ и типовые оценочные материалы:

КТ-1

Тема 1.

Тестирование.

КТ-2

Тема 2.

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

КТ-3

Тема 3.

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

КТ-4**Тема 4.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

КТ-5**Тема 5.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

КТ-6**Тема 6.**

Тестирование.

Контрольная работа.

КТ-7**Тема 7.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

КТ-8**Тема 8.**

Профессионально-исследовательское задание (ПИЗ).

5.2. Типовые оценочные материалы для текущего контроля успеваемости обучающихся (вне контрольных точек):
приведены в п.6.2.

5.3. Один или несколько тематических блоков дисциплины завершаются контрольной точкой (далее – КТ). Текущий контроль успеваемости по дисциплине предусматривает одну КТ в течение периода освоения дисциплины.

Максимальное количество баллов за любой тип работ в рамках КТ составляет 100 (сто) баллов.

Распределение весовых коэффициентов по КТ в рамках текущего контроля успеваемости по дисциплине и формулы расчета:

| Наименование контрольной точки | Максимальное количество баллов за работу в рамках КТ, которое может набрать обучающийся | Коэффициент веса контрольной точки | Результат контрольной точки, участвующий в формировании итоговой балльной оценки по дисциплине (отражается в журнале БРС в СДО) |
|--------------------------------|---|------------------------------------|---|
| 1 семестр | | | |
| КТ 1 | 100 | 0,6 | 60 |
| Итого: | x | 0,6 | 60 |

Формула расчета результата контрольной точки:

Результат контрольной точки = Количество баллов за работу в рамках КТ X Коэффициент веса контрольной точки.

5.4. Формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ и типовые оценочные материалы:

5 семестр

КТ – 1.

Тема 6:

Контрольная работа,
тестирование по теме 6,

Для каждой формы текущего контроля успеваемости обучающихся в рамках КТ определены критерии оценивания результатов выполнения задания.

1. Критерии оценивания тестирования:

| Критерии оценки | Диапазон баллов | Описание критерия |
|--------------------------------------|-----------------|--|
| <i>Количество правильных ответов</i> | <i>0</i> | <i>Количество правильных ответов менее 55%</i> |
| | <i>25</i> | <i>Количество правильных ответов от 55% до 64%</i> |
| | <i>50</i> | <i>Количество правильных ответов от 65% до 74%</i> |
| | <i>75</i> | <i>Количество правильных ответов от 75% до 84%</i> |
| | <i>100</i> | <i>Количество правильных ответов</i> |

| | | |
|--------------------|-----|-----------------------|
| | | <i>от 85% до 100%</i> |
| Итого максимально: | 100 | |

2. Критерии оценивания ПКЗ:

| Критерии оценки | Диапазон баллов | Описание критерия |
|---|-----------------|---|
| <i>Содержание и раскрытие выбранных понятий</i> | <i>41-70</i> | <i>Детальное, последовательное описание всех понятий на примере выбранной системы</i> |
| | <i>21-40</i> | <i>Поверхностное описание без привязки к выбранной системе</i> |
| | <i>0-20</i> | <i>Понятия раскрыты минимально или не раскрыты вовсе</i> |
| <i>Количество выполненных заданий</i> | <i>30</i> | <i>Количество выполненных заданий от 85% до 100%</i> |
| | <i>15</i> | <i>Количество выполненных заданий от 55% до 84%</i> |
| | <i>0</i> | <i>Количество выполненных заданий менее 55%</i> |
| Итого максимально: | 100 | |

3. Критерии оценивания ПИЗ:

| Критерии оценки | Диапазон баллов | Описание критерия |
|---|-----------------|--|
| <i>Содержание и раскрытие выбранных понятий</i> | <i>31-50</i> | <i>Детальное, последовательное описание всех понятий на примере выбранной системы</i> |
| | <i>16-30</i> | <i>Поверхностное описание без привязки к выбранной системе</i> |
| | <i>0-15</i> | <i>Понятия раскрыты минимально или не раскрыты вовсе</i> |
| <i>Достоверность и актуальность информации</i> | <i>16-20</i> | <i>Представленная информация подтверждена ссылками на источники</i> |
| | <i>0-15</i> | <i>Представленная информация частично подтверждена ссылками на источники или не подтверждена</i> |
| <i>Количество выполненных заданий</i> | <i>30</i> | <i>Количество выполненных заданий от 85% до 100%</i> |
| | <i>15</i> | <i>Количество выполненных заданий от 55% до 84%</i> |

| | | |
|--------------------|-----|---|
| | 0 | <i>Количество выполненных заданий менее 55%</i> |
| Итого максимально: | 100 | |

5.5. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения задач открытого типа (кейсов, ПКЗ, ПИЗ), тестовых заданий студенту разрешается использование калькулятора; программ для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных. Для построения интеллект-карты и моделей в различных нотациях студенту можно использовать любой соответствующий онлайн-инструмент.

6. Формы промежуточной аттестации, критерии и шкала оценивания, типовые оценочные материалы по дисциплине

6.1. Промежуточная аттестация проводится в форме экзамена.

Экзамен поводится в письменной форме. Обучающийся получает экзаменационный билет с вариантами 3-х заданий различного типа. На выполнение заданий дается 40-60 минут. По завершении подготовки необходимо представить ответы в письменном виде, подробно изложив ход выполнения задания, сделать выводы (*при необходимости*).

При реализации промежуточной аттестации в ЭО/ДОТ могут быть использованы следующие формы: устно в ДОТ - в форме обоснованных ответов на задания различного типа; письменно в СДО - в форме письменного решения заданий различного типа; тестирование в СДО.

6.2. Типовые оценочные материалы промежуточной аттестации.

Вопросы для подготовки к зачету с оценкой.

1. Дать определение предмета эконометрики.
2. Сделать обзор основных эконометрических моделей.
3. Описать эконометрические функции. Рассмотреть производственную функцию Кобба-Дугласа.
4. Рассмотреть функция полезности, спроса-предложения, издержек.
5. Дать общую характеристику задач регрессионного анализа. Дать определение регрессионной модели.
6. Классифицировать регрессионные модели. Привести примеры.
7. Дать определение модели парной регрессии. Характеризовать классический метод наименьших квадратов, организацию его использовать для оценки параметров парной линейной регрессии.
8. Рассмотреть основные допущения классического метода наименьших квадратов.
9. Характеризовать организацию проверки допущений классического

- метода наименьших квадратов. Указать организацию анализа асимметрии, эксцесса, закона распределения остатка. Рассмотреть критерии и организацию проверки гипотезы о нормальном распределении случайно составляющей.
10. Характеризовать организацию оценки качества регрессионных моделей. Указать организацию оценки качества в R.
 11. Сделать обзор показателей качества регрессии. Указать содержание и организацию применения коэффициента детерминации, коэффициента парной корреляции. Привести примеры.
 12. Описать организацию оценки адекватности модели с помощью критерия Фишера.
 13. Объяснить организацию применения надстройки «Анализ данных» excel для решения задач регрессионного анализа.
 14. Сделать обзор возможностей пакета Veka и пакета Deductor (Loginom) при решении задач регрессионного анализа.
 15. Сделать обзор возможностей пакета SPSS при решении задач регрессионного анализа.
 16. Характеризовать ошибки аппроксимации с помощью регрессионных моделей. Выполнить сравнительный анализ. Привести примеры.
 17. Описать содержание и организацию проверки статистической значимости коэффициентов модели парной регрессии, организацию интервальной оценки, интервальной оценки отклика.
 18. Дать определение и привести примеры нелинейных регрессионных моделей. Охарактеризовать полиномиальные модели, их свойства. Описать организацию выбора модели. Указать методы линеаризации полиномиальной модели. Описать организацию построения полиномиальных моделей в R.
 19. Привести примеры гиперболических регрессионных моделей. Указать процедуру их линеаризации.
 20. Привести примеры степенных и показательных моделей. Показать организацию построения модели производственной функции Кобба-Дугласа. Характеризовать понятие эластичность функции. Указать возможности функции ЛГРФПРИБЛ().
 21. Описать организацию и особенности проверки качества нелинейной модели. Дать характеристику информационных критериев. Привести примеры их использования в R.
 22. Объяснить отличия в решении линеаризуемых и нелинеаризуемых нелинейных регрессионных моделей. Указать организацию и примеры использования надстройки «Поиск решения» для решения задачи построения нелинеаризуемой регрессионной модели.
 23. Характеризовать классическую модель множественной регрессии. Привести примеры построения моделей в excel и SPSS.
 24. Привести примеры построения множественных регрессионных моделей в R.

25. Сформулировать основные допущения множественной регрессионной модели.
26. Указать организацию оценки качества множественной регрессионной модели, организацию использования дисперсионного анализа и критерия Фишера при оценке качества модели.
27. Характеризовать содержание и разновидности пошаговой регрессии. Привести пример решения пошаговой регрессии в SPSS.
28. Характеризовать парные, частные и множественные коэффициенты корреляции. Указать организацию их оценки в R.
29. Характеризовать проблему мультиколлинеарности. Описать признаки мультиколлинеарности.
30. Объяснить пути устранения мультиколлинеарности.
31. Дать определение фиктивных переменных. Привести примеры регрессионных моделей с фиктивными переменными, регрессионные модели с переменной структурой, кусочно-линейной регрессии.
32. Определить регрессионные модели с бинарными откликами. Дать определение логит и пробит-регрессии. Раскрыть организацию решения задачи логистической регрессии в Deductor, в R.
33. Характеризовать проблему гетероскедастичности.
34. Дать характеристику обобщенного метода наименьших квадратов.
35. Характеризовать тесты проверки гетероскедастичности с помощью критерия Спирмена, критерия Голдфелда-Квандта, Бройша-Пагана.
36. Дать определение автокоррелированности остатков, критерия Дарбина-Ватсона. Привести примеры его вычисления в R.
37. Определить и классифицировать системы эконометрических уравнений. Дать определение системы одновременных уравнений. Привести примеры систем одновременных уравнений.
38. Характеризовать косвенный метод наименьших квадратов.
39. Определить и дать характеристику проблема идентифицируемости параметров и уравнений системы одновременных уравнений. Сформулировать необходимые и достаточные критерии оценки идентифицируемости системы одновременных уравнений.
40. Характеризовать двухшаговый метод наименьших квадратов. Привести примеры.
41. Характеризовать организацию решения задач регрессионного анализа в R. Объяснить синтаксис формул в R. Привести примеры.
42. Рассмотреть организацию проверки качества регрессионных моделей в R, организацию использования функции plot при оценке качества модели. Дать определение влиятельных наблюдений, наблюдений с высокой напряженностью.
43. Указать, как оценивать справедливость гипотезы о нормальном законе распределения случайной составляющей в R.
44. Рассмотреть организацию проверки качества регрессионных моделей в SPSS, организацию использования функции plot при оценке качества

модели. Дать определение влиятельных наблюдений, наблюдений с высокой напряженностью.

45. Указать, как оценивать справедливость гипотезы о нормальном законе распределения случайной составляющей в SPSS.

Типовые задания для зачета с оценкой.

Задача 1. Построить графики зависимости ожидаемой продолжительности жизни от суточной калорийности питания населения, используя диаграммы рассеивания.

Построить уравнение регрессии калорийности на продолжительность жизни, используя линию тренда на графике. Рассмотреть линейную, полиномиальную 2 и 3 порядков модели. Оценить качество аппроксимации и выбрать лучшую модель. Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

Проверить адекватность полученной модели. Оценить ошибки модели. Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Данные по странам за 1999 г. об ожидаемой продолжительности жизни и суточной калорийности питания населения

| Страна | Ожидаемая продолжительность жизни при рождении в 1999 г., лет | Суточная калорийность питания населения, ккал на душу |
|------------------|---|---|
| Бельгия | 77,2 | 3543 |
| Бразилия | 66,8 | 2938 |
| Великобритания | 77,2 | 3237 |
| Венгрия | 70,9 | 3402 |
| Германия | 77,2 | 3330 |
| Греция | 78,1 | 3575 |
| Дания | 75,7 | 3808 |
| Египет | 66,3 | 3289 |
| Израиль | 77,8 | 3272 |
| Индия | 62,6 | 2415 |
| Испания | 78,0 | 3295 |
| Италия | 78,2 | 3504 |
| Канада | 79,0 | 3056 |
| Казахстан | 67,7 | 3007 |
| Китай | 69,8 | 2844 |
| Латвия | 68,4 | 2861 |
| Нидерланды | 77,9 | 3259 |
| Норвегия | 78,1 | 3350 |
| Польша | 72,5 | 3344 |
| Республика Корея | 72,4 | 3336 |
| Россия | 66,6 | 2704 |
| Румыния | 69,9 | 2943 |
| США | 76,6 | 3642 |
| Турция | 69,0 | 3568 |

| | | |
|-----------|------|------|
| Украина | 68,8 | 2753 |
| Финляндия | 76,8 | 2916 |
| Франция | 78,1 | 3551 |
| Чехия | 73,9 | 3177 |
| Швейцария | 78,6 | 3280 |
| Швеция | 78,5 | 3160 |
| ЮАР | 64,1 | 2933 |
| Япония | 80,0 | 2905 |

Задача 2. В таблице приведены результаты доходов и расходов граждан России.

| | плат аТру да | О СоцВы платы | Доходы Собст | ДрДохо ды | Товары Услуги | ОбязПл атежи | Взносы | Недвиж имость | ПриростФИ нАктивов |
|-----|--------------------|---------------------|-----------------|--------------|------------------|-----------------|--------|------------------|-----------------------|
| 992 | 1 3,6 | 7 14,3 | 1 | 2,7 | 72,9 | 8,1 | 0,1 | 18,9 | 13,6 |
| 995 | 1 2,8 | 6 13,1 | 6,5 | 1,2 | 70,5 | 5,6 | 0,1 | 23,8 | 3,6 |
| 000 | 2 2,8 | 6 13,8 | 6,8 | 1,2 | 75,5 | 7,8 | 1,2 | 15,5 | 2,8 |
| 002 | 2 5,8 | 6 15,2 | 5,2 | 1,9 | 73,2 | 8,6 | 1,8 | 16,4 | 1,8 |
| 003 | 2 3,9 | 6 14,1 | 7,8 | 2,2 | 69,1 | 8,3 | 2 | 20,6 | 2,7 |
| 004 | 2 5 | 6 12,8 | 8,3 | 2,2 | 69,9 | 9,1 | 2,3 | 18,7 | 1,8 |
| 005 | 2 3,6 | 6 12,7 | 10,3 | 2 | 69,5 | 10,1 | 2,6 | 17,8 | 1,5 |
| 006 | 2 5 | 6 12 | 10 | 1,9 | 69 | 10,5 | 3,3 | 17,2 | 3,4 |
| 007 | 2 0,4 | 7 10,9 | 6,7 | 2 | 69,7 | 12,5 | 3,3 | 14,5 | 3,6 |

- С помощью корреляционного анализа проверить значимость факторов на уровне значимости 0,1 по отношению фактору «Оплата труда». Проверить значимость коэффициентов парной корреляции.

- Построить парные уравнения регрессии с помощью мастера диаграмм, а также функции ЛИНЕЙН (на примере пары оплата «труда-прирост» финансовых активов).

- Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

- Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 3. В таблице приведены результаты доходов и расходов граждан России

| | плат аТру | О СоцВы платы | Доходы Собст | ДрДохо ды | ТоварыУ слуги | ОбязПл атежи | Взнос ы | Недвижи мость | ПриростФИ нАктивов |
|--|--------------|---------------------|-----------------|--------------|------------------|-----------------|------------|------------------|-----------------------|
|--|--------------|---------------------|-----------------|--------------|------------------|-----------------|------------|------------------|-----------------------|

| | | | | | | | | | | |
|-----|----------|-----------|------|-----|------|------|-----|------|------|--|
| | да | | | | | | | | | |
| 992 | 1 3,6 | 7 14,3 | 1 | 2,7 | 72,9 | 8,1 | 0,1 | 18,9 | 13,6 | |
| 995 | 1 2,8 | 6 13,1 | 6,5 | 1,2 | 70,5 | 5,6 | 0,1 | 23,8 | 3,6 | |
| 000 | 2 2,8 | 6 13,8 | 6,8 | 1,2 | 75,5 | 7,8 | 1,2 | 15,5 | 2,8 | |
| 002 | 2 5,8 | 6 15,2 | 5,2 | 1,9 | 73,2 | 8,6 | 1,8 | 16,4 | 1,8 | |
| 003 | 2 3,9 | 6 14,1 | 7,8 | 2,2 | 69,1 | 8,3 | 2 | 20,6 | 2,7 | |
| 004 | 2 5 | 6 12,8 | 8,3 | 2,2 | 69,9 | 9,1 | 2,3 | 18,7 | 1,8 | |
| 005 | 2 3,6 | 6 12,7 | 10,3 | 2 | 69,5 | 10,1 | 2,6 | 17,8 | 1,5 | |
| 006 | 2 5 | 6 12 | 10 | 1,9 | 69 | 10,5 | 3,3 | 17,2 | 3,4 | |
| 007 | 2 0,4 | 7 10,9 | 6,7 | 2 | 69,7 | 12,5 | 3,3 | 14,5 | 3,6 | |

• Оценить с помощью корреляционного анализа значимость влияния факторов на отклик.

• Построить множественную линейную модель для значимых факторов. Оценить значимость коэффициентов модели на уровне значимости 0,1. Откликом выбрать – Прирост финансовых активов.

• Выполнить диагностику мультиколлинеарности.

• Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

• Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 4. В таблице приведены результаты доходов и расходов граждан России.

| | Оплата Труда | СоцВып латы | Доходы Собст | ДрДохо ды | Товары Услуги | ОбязПл атежи | Взно сы | Недвиж имость | ПриростФИ нАктивов |
|-----|-----------------|----------------|-----------------|--------------|------------------|-----------------|------------|------------------|-----------------------|
| 992 | 1 73,6 | 14,3 | 1 | 2,7 | 72,9 | 8,1 | 0,1 | 18,9 | 13,6 |
| 995 | 1 62,8 | 13,1 | 6,5 | 1,2 | 70,5 | 5,6 | 0,1 | 23,8 | 3,6 |
| 000 | 2 62,8 | 13,8 | 6,8 | 1,2 | 75,5 | 7,8 | 1,2 | 15,5 | 2,8 |
| 002 | 2 65,8 | 15,2 | 5,2 | 1,9 | 73,2 | 8,6 | 1,8 | 16,4 | 1,8 |
| 003 | 2 63,9 | 14,1 | 7,8 | 2,2 | 69,1 | 8,3 | 2 | 20,6 | 2,7 |
| 004 | 2 65 | 12,8 | 8,3 | 2,2 | 69,9 | 9,1 | 2,3 | 18,7 | 1,8 |
| 005 | 2 63,6 | 12,7 | 10,3 | 2 | 69,5 | 10,1 | 2,6 | 17,8 | 1,5 |
| 006 | 2 65 | 12 | 10 | 1,9 | 69 | 10,5 | 3,3 | 17,2 | 3,4 |

| | | | | | | | | | | |
|-----|---|------|------|-----|---|------|------|-----|------|-----|
| 007 | 2 | 70,4 | 10,9 | 6,7 | 2 | 69,7 | 12,5 | 3,3 | 14,5 | 3,6 |
|-----|---|------|------|-----|---|------|------|-----|------|-----|

• Построить множественную линейную модель для значимых факторов. Откликом выбрать – Прирост финансовых активов. Факторами – оплата труда и доходы от собственности.

• Проверить значимость коэффициентов и адекватность модели на уровне значимости 0.2.

• Оценить автокорреляцию остатков с помощью критерия Дарбина-Ватсона. Пороговые значения для данного критерия равны 1,1 и 1,54 соответственно.

• Выполнить диагностику мультиколлинеарности.

• Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

• Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 5. В таблице хранятся данные по некоторым макроэкономическим показателям России (Доход, ВВП, инвестиции в млрд. руб., Численность экономически активного населения, тыс. чел., Сальдо торгового баланса, в млн. \$).

| | Доход | ВВП | Эф_население | Инвест | Сальдо |
|------|---------|---------|--------------|---------|--------|
| 1995 | 910,9 | 1428,5 | 70740 | 266974 | 19816 |
| 2000 | 3983,9 | 7305,6 | 72332 | 1165234 | 60171 |
| 2001 | 5325,8 | 8493,6 | 71411 | 1504712 | 48120 |
| 2002 | 6831 | 10830,5 | 72629 | 1762407 | 46335 |
| 2003 | 8900,5 | 13243,2 | 73198 | 2186365 | 59859 |
| 2004 | 10976,3 | 17048,1 | 73359 | 2804834 | 85825 |
| 2005 | 13667,8 | 21620,1 | 74261 | 3534009 | 118266 |

• Задать факторы Доход, инвестиции в млрд. руб., Сальдо, в млн. \$ и отклик ВВП.

• Исследовать мультиколлинеарность факторов с помощью корреляционной матрицы.

• Оценить отличие коэффициентов корреляции от нуля с помощью коэффициентов частной корреляции.

• Решить задачу построения модели пошагово.

• Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

• Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 6. Исследовать регрессионную модель, описывающую временной ряд. Данные хранятся в таблице. При построении модели в качестве базового уровня выбрать 1955 год. Данный номер принять за единицу

| Год | Уровень ряда |
|------|--------------|
| 1955 | 8,8 |
| 1956 | 9,9 |

| | |
|------|------|
| 1957 | 8,7 |
| 1958 | 11,3 |
| 1959 | 10,4 |
| 1960 | 10,9 |
| 1961 | 10,7 |
| 1962 | 10,9 |
| 1963 | 8,8 |
| 1964 | 11,4 |
| 1965 | 9,8 |
| 1966 | 13,9 |
| 1967 | 12,1 |
| 1968 | 14 |
| 1969 | 13,2 |
| 1970 | 15,6 |
| 1971 | 15,4 |
| 1972 | 14 |
| 1973 | 17,6 |
| 1974 | 15,4 |
| 1975 | 10,9 |
| 1976 | 17,5 |
| 1977 | 15 |
| 1978 | 18,5 |
| 1979 | 14,2 |
| 1980 | 14,9 |
| 1981 | 12,6 |
| 1982 | 15,2 |
| 1983 | 15,9 |
| 1984 | 14,4 |
| 1985 | 16,8 |
| 1986 | 18 |
| 1987 | 18,3 |
| 1988 | 17 |
| 1989 | 18,8 |
| 1993 | 15,7 |
| 1998 | 15,1 |
| 2001 | 19,4 |
| 2002 | 19,6 |
| 2003 | 17,8 |
| 2004 | 18,8 |
| 2005 | 18,5 |

- Проверить гетероскедастичность модели с помощью критерия Голдельда-Квандта и Брауша-Пагана.
- Исследовать качество модели
- Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.
- Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 7. Исследовать регрессионную модель, описывающую временной ряд. В качестве базового уровня выбрать 1955 год. Данные хранятся в таблице.

| Год | Уровень ряда |
|------|--------------|
| 1955 | 8,8 |
| 1956 | 9,9 |
| 1957 | 8,7 |
| 1958 | 11,3 |
| 1959 | 10,4 |
| 1960 | 10,9 |
| 1961 | 10,7 |
| 1962 | 10,9 |
| 1963 | 8,8 |
| 1964 | 11,4 |
| 1965 | 9,8 |
| 1966 | 13,9 |
| 1967 | 12,1 |
| 1968 | 14 |
| 1969 | 13,2 |
| 1970 | 15,6 |
| 1971 | 15,4 |
| 1972 | 14 |
| 1973 | 17,6 |
| 1974 | 15,4 |
| 1975 | 10,9 |
| 1976 | 17,5 |
| 1977 | 15 |
| 1978 | 18,5 |
| 1979 | 14,2 |
| 1980 | 14,9 |
| 1981 | 12,6 |
| 1982 | 15,2 |
| 1983 | 15,9 |
| 1984 | 14,4 |
| 1985 | 16,8 |
| 1986 | 18 |
| 1987 | 18,3 |
| 1988 | 17 |
| 1989 | 18,8 |
| 1993 | 15,7 |
| 1998 | 15,1 |
| 2001 | 19,4 |
| 2002 | 19,6 |
| 2003 | 17,8 |
| 2004 | 18,8 |
| 2005 | 18,5 |

- Проверить гетероскедастичность модели с помощью коэффициента критерия Гольтфелда-Квандта.

- С помощью оценки асимметрии и эксцесса оценить гипотезу о том, что ошибки аппроксимации подчинены нормальному закону распределения. Для оценки асимметрии и эксцесса использовать описательную статистику надстройки «Анализ данных», а также критерий Жаке-Бери. Данный критерий в R хранится в библиотеке `tseries (jarque.bera.test {tseries})`.
- Исследовать качество модели. Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.
- Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 8. Имеется выборка, которая описывает динамику ряда за указанный отрезок времени. В качестве базового уровня выбрать 1959 год.

| Year | Y |
|------|-------|
| 1959 | 117,5 |
| 1970 | 129,9 |
| 1979 | 137,4 |
| 1989 | 147 |
| 1992 | 148,3 |
| 1993 | 148,3 |
| 1994 | 148 |
| 1995 | 147,9 |
| 2002 | 145,2 |

- Построить линейную регрессионную модель.
- Построить модель параболического вида.
- Построить модель третьего порядка.

Выбрать лучшую модель с помощью критериев R^2 , F, а также информационных критериев.

Сравнить с логарифмической и степенной моделями, построенными с помощью мастера диаграмм excel.

• Исследовать качество модели. Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

- Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 9. Построить модель производственной функции Кобба-Дугласа по имеемой выборке

$$Y = A \cdot K^\alpha \cdot L^\beta \cdot \varepsilon$$

| Год | Y | K | L |
|------|-----|-----|-----|
| 1910 | 100 | 100 | 100 |
| 1911 | 101 | 107 | 105 |
| 1912 | 112 | 114 | 110 |
| 1913 | 122 | 122 | 118 |
| 1914 | 124 | 131 | 123 |
| 1915 | 122 | 138 | 116 |
| 1916 | 143 | 149 | 125 |
| 1917 | 152 | 163 | 133 |
| 1918 | 151 | 176 | 138 |

| | | | |
|------|-----|-----|-----|
| 1919 | 126 | 185 | 121 |
| 1920 | 155 | 198 | 140 |
| 1921 | 159 | 208 | 144 |
| 1922 | 153 | 153 | 145 |
| 1923 | 177 | 177 | 152 |
| 1924 | 184 | 184 | 154 |
| 1925 | 169 | 169 | 149 |
| 1926 | 189 | 189 | 154 |
| 1927 | 225 | 225 | 182 |
| 1928 | 227 | 227 | 196 |
| 1929 | 223 | 223 | 200 |
| 1930 | 218 | 218 | 193 |
| 1931 | 231 | 231 | 193 |
| 1932 | 179 | 179 | 147 |
| 1933 | 240 | 240 | 161 |

- Оценить качество модели с помощью показателей MAE , $MAPE$.
- Определить коэффициенты эластичности по труду и по капиталу.
- Оценить эффект масштаба, анализируя параметры модели α, β .
- Задачу решить, линеаризуя данную степенную модель.
- Как изменится модель, если ее нельзя линеаризовать?
- Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 10. Известны следующие данные

| Душевой доход (долл.,у) | Индекс человек. развития (x1) | Индекс человек. Бедности (x2) |
|----------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| 1600 | 0,866 | 14,9 |
| 7100 | 0,833 | 11,7 |
| 6750 | 0,833 | 11,7 |
| 6130 | 0,801 | 18,8 |
| 6110 | 0,848 | 10,7 |
| 4190 | 0,73 | 10,9 |
| 3850 | 0,514 | 34,8 |
| 3680 | 0,566 | 41,7 |
| 3650 | 0,717 | 22,8 |
| 3280 | 0,711 | 20,7 |
| 2680 | 0,672 | 17,7 |
| 2600 | 0,589 | 22,5 |
| 2600 | 0,626 | 17,5 |
| 2200 | 0,513 | 17,3 |
| 2150 | 0,445 | 46,8 |
| 1370 | 0,328 | 41,3 |
| 1350 | 0,393 | 41,6 |
| 1350 | 0,446 | 36,7 |

Построить нелинейные регрессионные модели:

$$Y = b_0 X_1^{b_1} X_2^{b_2}$$

$$Y = b_0 X_2^{b_1}$$

$$Y = b_0 X_1^{b_1}$$

- Все задачи решить линеаризацией путем логарифмирования.
- Выбрать наилучшую модель регрессии.
- Решить первую модель, если она нелинеаризируемая
- Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Задача 11. Построить регрессионную модель стоимости фиксированного набора потребительских товаров и услуг.

| | Стоимость набора, рублей в расчете на месяц |
|-------------|--|
| 2006 | |
| Январь | 4913,8 |
| Февраль | 5018,6 |
| Март | 5068,3 |
| Апрель | 5079,2 |
| Май | 5101,5 |
| Июнь | 5116,7 |
| Июль | 5157,3 |
| Август | 5149,5 |
| Сентябрь | 5135,2 |
| Октябрь | 5148,1 |
| Ноябрь | 5185,9 |
| Декабрь | 5231,3 |
| 2007 | |
| Январь | 5421,2 |
| Февраль | 5545,5 |
| Март | 5585,2 |
| Апрель | 5616,1 |
| Май | 5663,8 |
| Июнь | 5735,5 |
| Июль | 5797,5 |
| Август | 5776,8 |
| Сентябрь | 5815,4 |
| Октябрь | 5930,4 |
| Ноябрь | 5999,8 |
| Декабрь | 6068,3 |
| 2008 | |
| Январь | 6334,1 |
| Февраль | 6441,0 |
| Март | 6533,9 |
| Апрель | 6648,4 |
| Май | 6760,8 |
| Июнь | 6803,7 |
| Июль | 6812,6 |
| Август | 6795,4 |

| | |
|-------------|--------|
| Сентябрь | 6831,2 |
| Октябрь | 6896,3 |
| Ноябрь | 6943,3 |
| Декабрь | 6973,6 |
| 2009 | |
| Январь | 7292,0 |
| Февраль | 7397,6 |
| Март | 7481,3 |
| Апрель | 7518,7 |
| Май | 7570,1 |
| Июнь | 7626,3 |
| Июль | 7684,2 |
| Август | 7667,5 |
| Сентябрь | 7648,8 |
| Октябрь | 7652,1 |
| Ноябрь | 7682,0 |
| Декабрь | 7714,1 |

•Оценить качество модели. Выполнить диагностику наблюдений, аномальные, влиятельные, наблюдения высокой напряженности.

•Решить задачу в excel, JASP, python, R, orange.

Типовые проверочные задания для самоподготовки обучающегося к промежуточной аттестации:

| ТИП ЗАДАНИЯ | СЦЕНАРИИ ВЫПОЛНЕНИЯ | ТИПОВЫЕ ЗАДАНИЯ |
|---|---|---|
| Задание закрытого типа с выбором одного правильного ответа из нескольких вариантов предложенных | 1.Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов. 2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа. 3. Выбрать один верный ответ. 4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа (например, 3 или B). | 1. Диаграмма рассеяния указывает на нелинейную зависимость. В этом случае следует осуществить ... - подбор преобразования переменных, дающего наибольшее по абсолютной величине значение коэффициента парной корреляции - включение в модель дополнительных факторных признаков - расчет линейного коэффициента корреляции и использование линейной модели - визуальный подбор функциональной зависимости нелинейного характера, соответствующего структуре точечного графика |
| | | 2.Как влияет увеличение объема выборки на величину остаточной дисперсии случайной величины? а. никак б. остаточная дисперсия уменьшается с. результат зависит от конкретного вида случайной величины д. результат необходимо верифицировать и сделать вывод о величине дисперсии. Данная величина определяет возможный вариант е. остаточная дисперсия увеличивается |
| Задание закрытого типа на установление соответствия | 1.Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидаются пары элементов. 2. Внимательно прочитать оба списка: список 1 – вопросы, | 1.Установите соответствие между наименованиями элементов уравнения $y = \beta_0 + \beta_1x + \varepsilon$ и их буквенными обозначениями: 1. параметры регрессии 2. объясняющая переменная |

| | | |
|--|--|--|
| | <p>утверждения, факты, понятия и т.д.; список 2 – утверждения, свойства объектов и т.д.</p> <p>3. Сопоставить элементы списка 1 с элементами списка 2, сформировать пары элементов.</p> <p>4. Записать попарно буквы и цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа (например, А1 или Б4).</p> | <p>3. объясняемая переменная</p> <p>4. случайные отклонения</p> <p>ВАРИАНТЫ ОТВЕТОВ:</p> <p>A. y</p> <p>B. β_0, β_1</p> <p>C. x</p> <p>D. ε_e</p> <hr/> <p>2. Установите соответствие между названием модели и видом ее уравнения:</p> <p>1. линейная</p> <p>2. полиномиальная</p> <p>3. показательная</p> <p>4. полулогарифмическая</p> <p>ВАРИАНТЫ ОТВЕТОВ:</p> <p>A. $y = \beta_0 \cdot \ln x \cdot \varepsilon$</p> <p>B. $y = \beta_0 + \beta_1 x + \varepsilon$</p> <p>C. $y = \beta_0 \cdot \beta_1^x \cdot \varepsilon$</p> <p>D. $y = \beta_0 + \beta_1 x + \beta_2 x^2 + \varepsilon$</p> |
| <p>Задание закрытого типа с выбором нескольких правильных ответов из нескольких вариантов предложенных</p> | <p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается несколько правильных ответов из предложенных вариантов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Выбрать несколько правильных ответов.</p> <p>4. Записать только номера (или буквы) выбранного варианта ответа (например, 1 4 или А Г).</p> | <p>1. Какие утверждения справедливы для модели линейной регрессии?</p> <p>a) модель описывает зависимость переменной Y от X с использованием прямой линии.</p> <p>b) коэффициенты модели определяются методом наименьших квадратов.</p> <p>c) предполагает наличие сильной корреляции между признаками.</p> <p>d) применима исключительно для непрерывных признаков.</p> <p>e) все коэффициенты равны нулю, если нет зависимости между признаком и результатом.</p> <hr/> <p>2. Что характерно для моделей нелинейной регрессии?</p> <p>a) зависимость переменных отображается криволинейной функцией.</p> <p>b) применение метода градиентного спуска для оптимизации параметров.</p> <p>c) может включать полиномиальные, экспоненциальные или логистические связи.</p> <p>d) использует метод максимизации правдоподобия для оценки параметров.</p> <p>e) всегда требует больших вычислительных ресурсов по сравнению с линейной моделью.</p> |
| <p>Задание закрытого типа на установление последовательности</p> | <p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается последовательность элементов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Построить верную последовательность из предложенных элементов.</p> <p>4. Записать буквы/цифры (в зависимости от задания) вариантов ответа в нужной</p> | <p>1. Установите правильную последовательность шагов построения и анализа модели множественной линейной регрессии:</p> <p>a) Проверка статистической значимости коэффициентов модели (например, t-тест)</p> <p>b) Сбор и предварительная обработка исходных данных</p> <p>c) Интерпретация результатов модели</p> <p>d) Выбор подходящего набора предикторов</p> <p>e) Построение уравнения регрессии</p> <p>f) Анализ качества модели (R-квадрат, остаточная диагностика)</p> |

| | | |
|--|--|---|
| | <p>последовательности (например, БВА или 135).</p> | <p>2. Расставьте этапы построения и анализа нелинейной регрессионной модели в правильном порядке:</p> <p>а) Определение формы нелинейной зависимости (полиномиальной, экспоненциальной, логистической и др.)</p> <p>б) Вычисление оценок параметров модели методами оптимизаций (градиентный спуск, квази-Ньютоновские методы и др.)</p> <p>в) Проверка условий и допущений (нормальность распределений, отсутствие мультиколлинеарности и гетероскедастичности)</p> <p>г) Сбор и предварительная обработка данных</p> <p>д) Оценка качества модели (анализ остатков, вычисление коэффициента детерминации R^2, F-статистики и др.)</p> <p>е) Интерпретация результатов модели и принятие решений</p> |
| <p>Задание комбинированного типа с выбором одного правильного ответа из предложенных и обоснованием выбора</p> | <p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять, что в качестве ответа ожидается только один из предложенных вариантов.</p> <p>2. Внимательно прочитать предложенные варианты ответа.</p> <p>3. Выбрать один верный ответ.</p> <p>4. Записать только номер (или букву) выбранного варианта ответа.</p> <p>5. Записать аргументы, обосновывающие выбор ответа (например, 4 текст обоснования).</p> | <p>1. Рассмотрите следующую ситуацию: Допустим, вы построили две разные регрессионные модели для предсказания цены квартиры:</p> <p>Первая модель основана на одном факторе — площади квартиры (одномерная линейная регрессия).</p> <p>Вторая модель учитывает сразу несколько факторов: площадь квартиры, количество комнат, этаж, район расположения (многомерная линейная регрессия).</p> <p>Какой из утверждений верно характеризует преимущества второй модели над первой?</p> <p>А) Вторая модель даёт лучшие прогнозы благодаря учёту большего числа важных характеристик недвижимости.</p> <p>Б) Использование единственной независимой переменной всегда упрощает интерпретацию результата.</p> <p>В) Одномерная модель быстрее обрабатывается компьютером, так как в ней меньше параметров.</p> <p>Г) Если дом построен недавно, то цена обязательно увеличится вне зависимости от количества этажей.</p> <p>Ваш ответ: Правильным вариантом является _____, потому что _____.</p> <p>_____.</p> <p>Варианты ответа:</p> <p>1) вторая модель лучше первой</p> <p>2) первая модель проще интерпретируется</p> <p>3) первая модель работает быстрее</p> <p>4) новая постройка повышает цену независимо от этажа</p> <p>2. Рассмотрим простую линейную регрессионную модель, где исследуется связь между двумя переменными: площадью дома (X) и стоимостью жилья (Y). Формула линейной регрессии имеет вид: $Y = a + bX$</p> <p>где Y — предсказанная стоимость жилища, a — свободный коэффициент (пересечение оси ординат), b — коэффициент наклона, показывающий влияние изменения площади на стоимость жилья.</p> <p>Предположим, вам сообщили следующее: Значение свободного члена (a) равно 100 000.</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | | <p>Коэффициент наклона (b) равен 200. Тогда какое утверждение верно? Выберите один правильный ответ:</p> <p>А) Каждый дополнительный квадратный метр увеличивает стоимость жилья ровно на 200.</p> <p>Б) Стоимость любого дома равна произведению его площади на 200200, плюс 100 000.</p> <p>В) Если площадь нулевая, то стоимость жилья составит ровно 100 000.</p> <p>Г) Увеличение стоимости дома прямо пропорционально росту площади с постоянным множителем 200.</p> <p>Ваш ответ: Правильный вариант — _____, потому что _____</p> |
| Задание открытого типа с развернутым ответом | <p>1. Внимательно прочитать текст задания и понять суть вопроса.</p> <p>2. Продумать логику и полноту ответа.</p> <p>3. Записать ответ, используя четкие компактные формулировки.</p> <p>4. В случае расчетной задачи, записать решение и ответ</p> | <p>1. Найти значение критерия Бауша-Пагана для парной линейной регрессии, если исследуется зависимость двух величин x, y, заданных последовательностями $x \leftarrow \text{seq}(1, 12)$; $y \leftarrow c(81, 112, 132, 147, 154, 152, 138, 122, 129, 143, 145, 148)$. для решения задачи использовать функцию, находящуюся в пакете <code>car</code>. Чему равно наблюдаемое значение критерия. Ответ дать с точностью до одного знака после запятой.</p> <p>2. Даны две последовательности: $x \leftarrow \text{seq}(1, 8)$; $y \leftarrow c(81, 112, 132, 147, 154, 152, 138, 142)$. Для оценки значения коэффициентов кубической модели зависимости y от x с помощью функции <code>nls</code> заданы начальные значения коэффициентов 20, 1, 1, 0.1. Определить уровень значимости коэффициента при x^3. Ответ дать с точностью до двух знаков после запятой.</p> |

6.3. Критерии и шкала оценивания на основе БРС.

Критерии и балльная шкала определяются преподавателем

| КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ | РЕЗУЛЬТАТ В БАЛЛАХ |
|--|--------------------|
| Дан полный, в логической последовательности развернутый ответ на поставленный вопрос, где он продемонстрировал знания предмета в полном объеме учебной программы, достаточно глубоко осмысливает дисциплину, самостоятельно, и исчерпывающе отвечает на дополнительные вопросы, приводит собственные примеры по проблематике поставленного вопроса, решил предложенные практические задания без ошибок | 40 |
| Дан развернутый ответ на поставленный вопрос, где студент демонстрирует знания, приобретенные на лекционных и семинарских занятиях, а также полученные посредством изучения обязательных учебных материалов по курсу, дает аргументированные ответы, приводит примеры, в ответе присутствует свободное владение монологической речью, логичность и последовательность ответа. Однако допускается неточность в ответе. Решил предложенные практические задания с небольшими неточностями. | 30-39 |
| Дан ответ, свидетельствующий в основном о знании процессов | 20-29 |

| | |
|---|------|
| <p>изучаемой дисциплины, отличающийся недостаточной глубиной и полнотой раскрытия темы, знанием основных вопросов теории, слабо сформированными навыками анализа явлений, процессов, недостаточным умением давать аргументированные ответы и приводить примеры, недостаточно свободным владением монологической речью, логичностью и последовательностью ответа. Допускается несколько ошибок в содержании ответа и решении практических заданий.</p> | |
| <p>Дан ответ, который содержит ряд серьезных неточностей, обнаруживающий незнание процессов изучаемой предметной области, отличающийся неглубоким раскрытием темы, незнанием основных вопросов теории, несформированными навыками анализа явлений, процессов, неумением давать аргументированные ответы, слабым владением монологической речью, отсутствием логичности и последовательности. Выводы поверхностны. Решение практических заданий не выполнено, т.е. студент не способен ответить на вопросы даже при дополнительных наводящих вопросах преподавателя.</p> | 0-19 |

6.4. Описание дополнительных материалов и оборудования, необходимых для выполнения проверочных заданий (*при необходимости*).

Для решения задач открытого типа (кейсов, ПКЗ, ПИЗ), тестовых заданий студенту разрешается использование калькулятора; программ для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных. Для построения интеллект-карты и моделей в различных нотациях студенту можно использовать любой соответствующий онлайн-инструмент.

7. Методические материалы по освоению дисциплины (модуля)

Для изучения основных вопросов образовательной программы необходимо конспектировать материалы лекций, работать с рекомендованной преподавателем литературой, а также ресурсами информационно-телекоммуникационной сети «Интернет». Для приобретения навыков активного использования знаний полезно обсуждать плановые и возникающие вопросы, а также решаемые задачи на практических занятиях. Чтобы легче и прочнее усвоить материал следует постоянно использовать конкретные примеры, сравнения из уже полученных областей наук.

Для закрепления изученного материала даны вопросы по каждой теме дисциплины, на которые следует самостоятельно найти ответы.

Важной составной частью учебного процесса в вузе являются практические занятия. Практические занятия проводятся главным образом по дисциплинам, требующим закрепления навыков решения задач, и помогают студентам глубже усвоить учебный материал, приобрести умения применять принципы системного подхода к решению разнообразных задач, определять и оценивать ресурсы и существующие ограничения разного рода проектов.

При подготовке к практическим занятиям необходимо проанализировать

конспект лекции, ознакомиться с рекомендованной литературой по соответствующей теме, осуществить подготовку по рекомендованным в рабочей программе вопросам для обсуждения темы, выполнить домашнее задание (при необходимости).

Необходимо помнить, что на лекции обычно рассматривается не весь материал, а только его часть. Остальная его часть восполняется в процессе самостоятельной работы. В связи с этим работа с рекомендованной литературой обязательна. Особое внимание при этом необходимо обратить на содержание основных положений и выводов, объяснение явлений и фактов, уяснение практического приложения рассматриваемых теоретических вопросов. В процессе этой работы студент должен стремиться понять и запомнить основные положения рассматриваемого материала, примеры, поясняющие его, а также разобраться в иллюстративном материале. В процессе подготовки к занятиям рекомендуется взаимное обсуждение материала, во время которого закрепляются знания, а также приобретает практика в изложении и разъяснении полученных знаний, развивается речь. При необходимости следует обращаться за консультацией к преподавателю (в том числе по электронной почте). Планируя консультацию, необходимо хорошо продумать вопросы, которые требуют разъяснения. Заканчивать подготовку следует составлением плана (конспекта) по изучаемому материалу (вопросу). Это позволяет составить концентрированное, сжатое представление по изучаемым вопросам. Записи имеют первостепенное значение для самостоятельной работы студентов. Они помогают понять построение изучаемого материала, выделить основные положения, проследить их логику. Кроме того, ведение записей способствует превращению чтения в активный процесс, мобилизует, наряду со зрительной, и моторную память. Следует помнить: у студента, систематически ведущего записи, создается свой индивидуальный фонд методических материалов для быстрого повторения изученных вопросов, для мобилизации накопленных знаний. Особенно важны и полезны записи тогда, когда в них находят отражение мысли, возникшие при самостоятельной работе.

После изучения базовых тем курса проводится текущий контроль знаний студентов в виде опроса или письменного тестирования. Типовые тесты и задания по темам дисциплины приведены в специальном разделе данной рабочей программы.

Подготовка к текущему и промежуточному контролю предполагает изучение представленных вопросов к зачету, работу над тестами, представленными в данной рабочей программе, выполнение семестровой проектной работы по применению системного подхода и методов системного анализа к выбранной системе.

Работа в малых группах – это одна из самых популярных форм проведения занятий, так как она дает всем обучающимся (в том числе и стеснительным) возможность участвовать в работе, практиковать навыки сотрудничества, межличностного общения (в частности, умение активно

слушать, вырабатывать общее мнение, разрешать возникающие разногласия). Цель данной формы проведения занятий: продемонстрировать сходство или различия определенных явлений, выработать стратегию или разработать план, выяснить отношение различных групп участников к одному и тому же вопросу. В ходе этой работы дополнительно решаются следующие задачи: развитие навыков общения и взаимодействия в группе, формирование ценностно-ориентационного единства группы, поощрение к гибкой смене социальных ролей в зависимости от ситуации.

Группа студентов делится на несколько малых групп. Количество групп определяется числом творческих заданий, которые будут обсуждаться в процессе занятия. Малые группы формируются либо по желанию студентов, либо по родственной тематике для обсуждения. Каждая малая группа обсуждает творческое задание в течение отведенного времени. Основным этапом – проведение обсуждения творческого задания. Заслушиваются суждения, предлагаемые каждой малой группой по творческому заданию. Преподаватель дает оценочное суждение о работе малых групп, по решению творческих заданий, и эффективности предложенных путей решения.

В качестве самостоятельной работы студентами выполняется семестровая работа по применению системного подхода и методов системного анализа к выбранной системе по всем темам. Рекомендуется выбрать организационно-техническую систему. Перед выполнением задания по теме 1 выбранную систему необходимо согласовать с преподавателем. При выполнении заданий по темам могут использоваться представленные студентом материалы по предыдущим темам. Выполненная семестровая работа представляется студентом на открытой защите на промежуточной аттестации.

8. Учебная литература и ресурсы информационно-телекоммуникационной сети Интернет

8.1. Основная литература

1. Агаларов, Зураб Сардарович, Орлов, Александр Иванович. Эконометрика. – М.: Дашков и К, 2021. – 380 с. Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1232779> (дата обращения: 23.12.2020). – Режим доступа: по подписке
2. Айвазян, Сергей Артемьевич, Фантацини Д. Эконометрика - 2 : продвинутый курс с приложениями в финансах. – Москва:Магистр [и др.]: 2024-944с. <https://znanium.ru/catalog/document?id=436999>, (дата обращения: 23.03.2025).
3. Бабешко, Людмила Олеговна, Орлова, Ирина Владленовна Эконометрика и эконометрическое моделирование в Excel и R. – М.: ИНФРМА-М, 2021. - 300 с. Текст : электронный. - URL: <https://znanium.com/catalog/product/1079837> (дата обращения: 28.10.2020). – Режим доступа: по подписке.
4. Елисеева Ирина Ильинична, Курышева Светлана Владимировна, Нерадовская Юлия Владимировна, Галиуллина Людмила Марселевна, Беляков Денис Игоревич и др. Эконометрика [Электронный ресурс]. – М.:Юрайт, 2018 – 449 с.
5. Кремер, Наум Шевелевич. Эконометрика. – М.: Юрайт, 2020 – 308 с. Текст : электронн. – М.: Юрайт, 2018. – 449с. ый // ЭБС Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/449750> (дата обращения: 16.10.2020).
6. Орлов, Александр Иванович. Эконометрика. - Саратов:Ай Пи Ар Медиа; Москва:ИНТУИТ, 2024. -676 с. Текст : электронный. - URL: <https://www.iprbookshop.ru/133992.html?replacement=1> (дата обращения: 30.04.2025).
7. Орлова И.В.,Бич М.Г. Экономико-математическое моделирование : практическое пособие по решению задач в Excel и R. - Москва:Вузовский учебник, - 189 с. <https://znanium.ru/catalog/document?id=421249#bib> (дата обращения: 30.04.2025)

8.2. Дополнительная литература

1. Айвазян С. А. Прикладная статистика и основы эконометрики// учебник для студ. эконом. специальностей вузов, рек. М-вом образования РФ / С. А. Айвазян, В. С. Мхитарян. - М.: ЮНИТИ, 1998. - 1022 с.
2. Балдин К. В. Эконометрика: учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальностям "Финансы и кредит", "Бухгалтерский учет, анализ и аудит", рек. М-вом образования РФ / К.В. Балдин, О.Ф. Быстров, М.М. Соколов. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2004. - 254 с.
3. Магнус Я. Р. Эконометрика: начальный курс: учебник, рек. М-вом общ. и проф. образования Рос. Федерации / Я. Н. Магнус, П. К. Катышев, А. А. Пересецкий. - 4-е изд. - М.: Дело, 2000. - 399 с.
4. Носко, Владимир Петрович. Эконометрика: учебник: [в 2 кн.] / В. П. Носко; Рос. акад. нар. хоз-ва и гос. службы при Президенте Рос. Федерации. - М.: Издат. дом "Дело" РАНХиГС, 2011. - (Серия "Академический учебник"). Кн. 1, ч. 1 : Основные понятия, элементарные методы ; ч. 2 : Регрессивный анализ временных рядов . - 671 с.
5. Наумов В. Н. Основы эконометрики: учеб. пособие [для студентов вузов, обучающихся по направлениям подготовки: 080500.62 - "Бизнес-информатика", 080100.62 - "Экономика"]: рек. М-вом образования и науки РФ / В. Н. Наумов. - СПб. : Изд-во СЗИУ РАНХиГС, 2013. - 278 с.
6. Эконометрика: учебник / [К. В. Балдин и др.]; под ред. В. Б. Уткина. - 2-е изд. - М. : Дашков и К, 2012. - 561 с. .

8.3. Нормативные правовые документы и иная правовая информация

Не используются

8.4 Интернет-ресурсы

Обучающимся обеспечен доступ к материалам курса в СДО Академии <http://lms.ranepa.ru>, а так же через сайт научной библиотеки к следующим подписным электронным ресурсам:

Русскоязычные ресурсы

- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Айбукс»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Юрайт»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «Лань»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «ZNANIUM.COM»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «BOOK.RU»
- Электронные учебники электронно-библиотечной системы (ЭБС) «IPR SMART»

9. Материально-техническая база, информационные технологии, программное обеспечение и информационные справочные системы

| № п/п | Наименование |
|-------|---|
| 1. | Специализированные залы для проведения лекций, оснащенные персональным компьютером/ноутбуком и мультимедийным проектором |
| 2. | Аудитории и компьютерные классы, оборудованные посадочными местами и персональными компьютерами с выходом в Интернет для проведения практических занятий |
| 3. | «МТС Линк» — российская платформа для онлайн-коммуникаций и совместной работы команд ; «Яндекс Телемост» — сервис для видеоконференций от Яндекса; Я-мессенджер |
| 4. | Технические средства обучения: персональные компьютеры; программные средства, обеспечивающие просмотр видеофайлов в форматах AVI, MPEG-4, DivX, RMVB, WMV; программы для работы с электронными таблицами для обработки, анализа и визуализации данных; соответствующие онлайн-инструменты для построения интеллект-карты и моделей в различных нотациях |
| 5. | Научная библиотека (в т.ч. электронные информационные ресурсы научной библиотеки) |
| 6. | СДО Академии https://lms.ranepa.ru/ |