#### МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Глазовский инженерно-экономический институт (филиал) федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования

«Ижевский государственный технический университет имени М.Т. Калашникова» (ГИЭИ (филиал) ФГБОУ ВО «ИжГТУ имени М.Т. Калашникова»)



## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

## <u>Эконометрика</u> наименование – полностью

направление (специальность)	38.03.01 Экономика
	код, наименование – полностью
направленность (профиль/	
программа/специализация)	Экономика и управление
F	наименование — полностью
уровень образования: бакалав	риат
	удалить ненужные варианты
форма обучения:	очно-заочная
ОЧ	ная/очно-заочная/заочная
_	_
общая трудоемкость дисципп	ины составляет: 5 зачетных елиниц(ы)

Кафедра	Экономика и менеджме	HT
	полное наименование кафедры,	представляющей рабочую программу
		ыкова Е.В., старший преподаватель тью), степень, звание
государств		ответствии с требованиями федерального гандарта высшего образования и рассмот-
Протокол о	от <u>24 марта</u> 2025 г. N	<u>6_3_</u>
Заведующі	ий кафедрой	И.В. Пронина 24.03.2025г.
СОГЛАС	ОВАНО	
		ы и формируемые компетенции соответ- омика профиль Экономика и управление
Председато	ель учебно-методической ко	омиссии ГИЭИА.Г. Гобушин
Руководит	ель образовательной програ	иммы И.В. Пронина 24.03.2025г.

### Аннотация к дисциплине

Название дисциплины	Б1.О.23 Эконометрика
Направление подготовки (специ-	38.03.01 – Экономика
альность)	
Направленность (про-	Экономика и управление
филь/программа/специализация)	
Место дисциплины	Обязательная часть Блока 1. Дисциплины (моду-
	ли)
Трудоемкость (з.е. / часы)	5/180
Цель изучения дисциплины	Цель преподавания дисциплины: ознакомление с
	основными понятиями эконометрики и методами
	решения практических задач.
Компетенции, формируемые в ре-	ОПК-2 Способен осуществлять сбор, обработку и
зультате освоения дисциплины	статистический анализ данных, необходимых для
	решения поставленных экономических задач.
Содержание дисциплины (основ-	Предмет и задачи курса. Парный линейный ре-
ные разделы и темы)	грессионный анализ. Метод наименьших квадра-
	тов (МНК). Качество модели парной линейной
	регрессии. Парный нелинейный регрессионный
	анализ. Качество модели парной нелинейной ре-
	грессии. Гетероскедастичность. Автокорреляция.
	Множественный регрессионный анализ (МРА).
	Качество модели МРА. Мультиколлинеарность.
Форма промежуточной аттеста-	Дифференцированный зачет (бсем)
ции	

#### 1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ДИСЦИПЛИНЫ

Эконометрика — это наука, в которой на базе экономической теории и реальных статистических данных строятся математические модели массовых экономических явлений с целью количественного подтверждения или опровержения определенных экономических гипотез и прогнозирования соответствующих показателей.

#### Целью освоения дисциплины является:

формирование у студентов компетенции ОПК-2 способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты.

#### Основные задачи дисциплины:

- научиться строить эконометрические модели;
- освоить методы корреляционного, регрессионного, факторного анализа, применяемых для построения эконометрических моделей;
- научиться применять современные цифровые инструменты для решения задач эконометрического моделирования, в работе с информацией при осуществлении профессиональной деятельности;
- научиться использовать результаты эконометрического анализа для прогноза и принятия обоснованных экономических решений.

#### 2. ПЛАНИРУЕМЫЕ РЕЗУЛЬТАТЫ ОБУЧЕНИЯ

В результате освоения дисциплины у студента должны быть сформированы:

#### Знания, приобретаемые в ходе изучения дисциплины

№ п/п	Знания
1.	Основные понятия эконометрики
	Основные эконометрические модели, используемых для анализа и оценки развития экономических и социальных систем
	Сущность и особенности применения основных методов оценки параметров модели, проверки качества параметров модели и самой модели в целом.

#### Умения, приобретаемые в ходе изучения дисциплины

№ n/n	Умения
1.	Проводить вычисление различных статистических и эконометрических показате-
	лей
2.	Построить на основе имеющейся статистической информации «наилучшую» эко-
	нометрическую модель, определять на основе экономических законов вид
	спецификации модели
3.	Правильно интерпретировать построенную модель и сформулировать выводы,
	вытекающие из ее интерпретации

#### Навыки, приобретаемые в ходе изучения дисциплины

№ n/n	Навыки
1	Владения методикой проведения экономических исследований
2	Владения методикой построения эконометрических моделей
3	Использования статистических пакетов для проведения расчетов, статистических таблиц, анализировать полученный результат с экономической, статистической и содержательной точек зрения

## Компетенции, приобретаемые в ходе изучения дисциплины

Компетенции	Индикаторы	Знания (№№ из 3.1)	Умения (№№ из 3.2)	Навыки (№№ из 3.3)
ОПК-2 Способен осуществлять	ОПК-2.1 Знать: основные	1-3		
сбор, обработку и статистиче-	методы сбора, анализа и			
ский анализ данных, необходи-	обработки статистической			
мых для решения поставленных	информации; порядок про-			
экономических задач.	ведения опросов, анкети-			
экономических задач.	рования и первичной обра-			
	ботки их результатов			
	ОПК-2.2 Уметь: собирать,		1-3	
	обрабатывать и анализиро-			
	вать статистические дан-			
	ные; проводить статисти-			
	ческие обследования,			
	опросы, анкетирование и			
	первичную обработку их			
	результатов			
	ОПК-2.3 Владеть: метода-			1-3
	ми сбора, анализа, обра-			
	ботки и интерпретации			
	статистической информа-			
	ции; методами построения			
	стандартных теоретиче-			
	ских и эконометрических			
	моделей			

### 3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП:

Дисциплина «Эконометрика» относится к базовой части Блока 1 «Дисциплины (модули)» ООП.

Дисциплина изучается на 3 курсе, в 6 семестре.

Дисциплина базируется на знаниях, полученных при изучении дисциплин: Математический анализ, Экономика, Эконометрическое моделирование.

Перечень последующих дисциплин (модулей), для которых необходимы знания, умения и навыки, формируемые данной учебной дисциплиной (модулем): Макроэкономическое планирование и прогнозирование.

## 4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

#### 4.1. Разделы дисциплины и виды занятий

№ п/ п	Раздел дисциплины. Форма промежуточной аттеста- ции (по семестрам)	его часов на разлел	C.	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)					Содержание самостоя- тельной работы	
		Bce			контактная			ктная СРС		
		<del>"</del>		лек	прак	лаб	КЧА	CFC		
1.	Предмет и задачи курса.		6	1				20	Подготовка к заче-	
									ту	
2.	Парный линейный регресси-		6	1		1		20	Защита лаборатор-	
	онный анализ. Метод								ной работы, подго-	
	наименьших квадратов								товка к зачету	

	Итого:	180		6	12	0,4	161,6	
	Дифференцированный зачет					Í	,	по билетам
	Пиффоронции ий ромот					0,4	1,6	товка к зачету Зачет проводится
8.	Мультиколлинеарность.		6		2		20	Защита лаборатор- ной работы, подго-
7.	Множественный регрессионный анализ (MPA). Качество модели MPA.		6		2		20	Защита лабораторной работы, подготовка к зачету
6.	Автокорреляция.		6	1	2		20	Защита лаборатор- ной работы, подго- товка к зачету
5.	Гетероскедастичность.		6	1	2		20	Защита лабораторной работы, подготовка к зачету
4.	Парный нелинейный регрессионный анализ. Качество модели парной нелинейной регрессии.		6	1	2		20	Защита лабораторной работы, подготовка к зачету
3.	(МНК). Качество модели парной линейной регрессии.		6	1	1		20	Защита лаборатор- ной работы, подго- товка к зачету

## 4.2.Содержание разделов курса

<u>№</u> n/n	Раздел дисциплины	Коды компетенции и индикаторов	Знания (номер из 3.1)	Умения (номер из 3.2)	Навы- ки (номер из 3.3)	Форма кон- троля
1.	Предмет и задачи курса: Определение эконометрики. Области применения эконометрических моделей. Цели и задачи эконометрических исследований. Этапы эконометрического исследования.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	1			Подго- товка к зачету
2.	Парная линейная регрессия: уравнение регрессии, его смысл и назначение. Нахождение коэффициентов линейной регрессии. Поле корреляции. Метод наименьших квадратов (МНК). Геометрическая интерпретация метода МНК.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	2	1, 3	1-3	Защита лабора- торной работы, подго- товка к зачету
3.	Качество модели парной линейной регрессии. Показатели качества: коэффициенты аппроксимации, детерминации, значимость коэффициентов регрессии и всего уравнения в целом.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	3	1, 3	1-3	Защита лабора- торной работы, подго- товка к зачету
4.	Парный нелинейный регрессионный анализ. Нелинейные модели	ОПК-2.1, ОПК-2.2,	2, 3	1, 3	1-3	Защита лабора-

	регрессии и их линеаризация. Качество модели парной нелинейной регрессии: коэффициенты аппроксимации, детерминации, значимость коэффициентов регрессии и всего уравнения в целом.	ОПК-2.3				торной работы, подго- товка к зачету
5.	Гетероскедастичность. Отрицательные последствия. Тесты по обнаружению: тест ранговой корреляции Спирмена, тест Голдфельда-Кванта, тест Глейзера. Устранение гетероскедастичности.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	3		3	Защита лабора- торной работы, подго- товка к зачету
6.	Автокорреляция. Тест Дарбина- Уотсона. Метод Кокрана- Оркатта.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	3	3	3	Защита лабора- торной работы, подго- товка к зачету
7.	Множественный регрессионный анализ (MPA). Качество модели MPA: коэффициенты детерминации и аппроксимации, значимость коэффициентов регрессии и всего уравнения в целом.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	2, 3	1, 2, 3	1-3	Защита лабора- торной работы, подго- товка к зачету
8.	Мультиколлинеарность: отрицательные последствия, признаки, методы борьбы, ее устранение.	ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3	3	3	3	Защита лабора- торной работы, подго- товка к зачету

# 4.3. Наименование тем лекций, их содержание и объем в часах

<b>№</b> п/п	№ раздела дисци-	Наименование тем лекций	Трудоем- кость
	плины		(час)
1.	1.	Предмет и задачи курса: Определение эконометрики. Области	1
		применения эконометрических моделей. Цели и задачи эконо-	
		метрических исследований. Этапы эконометрического иссле-	
		дования.	
2.	2.	Парная линейная регрессия: уравнение регрессии, его смысл и	1
		назначение. Нахождение коэффициентов линейной регрессии.	
		Поле корреляции. Метод наименьших квадратов (МНК). Гео-	
		метрическая интерпретация метода МНК.	
3.	3.	Качество модели парной линейной регрессии. Показатели ка-	1
		чества: коэффициенты аппроксимации, детерминации, значи-	
		мость коэффициентов регрессии и всего уравнения в целом.	
4.	4.	Парный нелинейный регрессионный анализ. Нелинейные мо-	1
		дели регрессии и их линеаризация. Качество модели парной	
		нелинейной регрессии: коэффициенты аппроксимации, детер-	

		минации, значимость коэффициентов регрессии и всего урав-	
		нения в целом.	
5.	5.	Гетероскедастичность. Отрицательные последствия. Тесты по обнаружению: тест ранговой корреляции Спирмена, тест Голдфельда-Кванта, тест Глейзера. Устранение гетероскедастичности.	1
6.	6.	Автокорреляция. Тест Дарбина-Уотсона. Метод Кокрана- Оркатта.	1
7.	7.	Множественный регрессионный анализ (MPA). Качество модели MPA: коэффициенты детерминации и аппроксимации, значимость коэффициентов регрессии и всего уравнения в целом.	-
8.	8.	Мультиколлинеарность: отрицательные последствия, признаки, методы борьбы, ее устранение.	-
		Всего часов	6

### 4.4. Наименование тем лабораторных занятий, их содержание и объем в часах

<b>№</b> π/π	№ раздела дисци- плины	Темы и содержание лабораторных занятий			
1.	2	Парная линейный регрессионный анализ. Метод наименьших	1		
		квадратов (МНК).			
2.	3	Качество модели парной линейной регрессии.	1		
3.	4	Парный нелинейный регрессионный анализ. Качество модели			
		парной нелинейной регрессии.			
4.	5	Гетероскедастичность.	2		
5.	6	Автокорреляция.	2		
6.	7	Множественный регрессионный анализ (МРА). Качество моде-	2		
		ли МРА.			
7.	8	Мультиколлинеарность.	2		
		Всего часов	12		

## 5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ТЕКУЩЕГО КОНТРОЛЯ УСПЕВАЕМОСТИ, ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ ПО ДИСЦИПЛИНЕ.

Для контроля освоения дисциплины проводится: защита лабораторных работ, зачет по билетам.

## 6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИ-ПЛИНЫ:

#### а) Основная литература

- 1. Кремер, Н. Ш. Эконометрика: учебник для студентов вузов / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко; под редакцией Н. Ш. Кремера. 3-е изд. Москва: ЮНИТИ-ДАНА, 2023. 328 с. ISBN 978-5-238-01720-4. Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. URL: https://www.iprbookshop.ru/141535.html (дата обращения: 26.09.2025). Режим доступа: для авторизир. пользователей
- 2. Михайлова, С. С. Эконометрика: учебник для бакалавриата / С. С. Михайлова, Н. В. Гринева, Н. В. Концевая. Москва: Прометей, 2024. 512 с. ISBN 978-5-00172-626-5. Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. URL: https://www.iprbookshop.ru/153461.html (дата обращения: 26.09.2025). Режим доступа: для авторизир. пользователей

3. Орлов, А. И. Эконометрика: учебник / А. И. Орлов. — Москва: Ай Пи Ар Медиа, 2024. — 525 с. — ISBN 978-5-4497-2540-0. — Текст: электронный // Цифровой образовательный ресурс IPR SMART: [сайт]. — URL: https://www.iprbookshop.ru/134694.html (дата обращения: 26.09.2025). — Режим доступа: для авторизир. пользователей. - DOI: https://doi.org/10.23682/134694

## б) Дополнительная литература

- 4. Бабешко Л.О., Бич М.Г., Орлова И.В. Эконометрика и эконометрическое моделирование. М.: Вузовский учебник: ИНФРА-М, 2018.
- 5. Белько И.В., Криштапович Е.А. Эконометрика. Практикум: учеб. пос. для вузов. Минск: Издательство Гревцова, 2011.
- 6. Бережная Е.В., Бережной В.И. Математические методы моделирования экономических систем.- М.: «Финансы и статистика», 2005.
- 7. Доугерти К. Введение в эконометрику. М.: Инфра-М, 2011.
- 8. Елисеева И.И. Эконометрика: учебник для бакалавриата и магистратуры. М.: Юрайт, 2015.
- 9. Елисеева И.И. Практикум по эконометрике. М.: Финансы и статистика, 2005.
- 10. Ершова, Н. А. Современная эконометрика [Электронный ресурс] : учебное пособие / Н. А. Ершова, С. Н. Павлов. Электрон. текстовые данные. М. : Российский государственный университет правосудия, 2018. 52 с. 978-5-93916-650-8. Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/78311.html
- 11. Ивченко Ю.С. Эконометрика в MS EXCEL [Электронный ресурс]: лабораторный практикум/ Ивченко Ю.С.— Электрон. текстовые данные.— Саратов: Ай Пи Эр Медиа, 2018.— 94 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/70785.html.— ЭБС «IPRbooks»
- 12. Каморников С.Ф., Каморников С.С. Эконометрика: учеб.пособие. М.: Интеграция, 2012.
- 13. Носко В.П. Эконометрика для начинающих: доп. главы. М.: Ин-т экономики переходного периода, 2005.
- 14. Эконометрика: Учебник/ Под ред. проф. В.Б.Уткина. М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2012.
- 15. Эконометрика [Электронный ресурс]: учебник/ К.В. Балдин [и др.].— Электрон. текстовые данные.— М.: Дашков и К, 2017.— 562 с.— Режим доступа: http://www.iprbookshop.ru/85150.html.— ЭБС «IPRbooks».

#### в) методические указания:

- 1. Лабораторный практикум по эконометрике. Глазов: Глазовский инженерно-экономический институт, 2018. Глазов: Глазовский инженерно-экономический институт, 2018.-64c.
- 2. Эконометрика: Теория в определениях и тесты. Глазов: Глазовский инженерно-экономический институт, 2018. 44с.

#### г) перечень ресурсов информационно-коммуникационной сети Интернет

- 1. Электронно-библиотечная система **IPRbooks** <a href="http://istu.ru/material/elektronno-bibliotechnaya-sistema-iprbooks">http://istu.ru/material/elektronno-bibliotechnaya-sistema-iprbooks</a>
- 2. Электронный каталог научной библиотеки ИжГТУ имени М.Т. Калашникова **Web ИРБИС** <a href="http://94.181.117.43/cgi-bin/irbis64r">http://94.181.117.43/cgi-bin/irbis64r</a> 12/cgiirbis 64.exe?LNG=&C21COM =F&I21DBN =IBIS&P21DBN=IBIS
- 3. Национальная электронная библиотека <a href="http://нэб.pd">http://нэб.pd</a>.
- 4. Научная электронная библиотека eLIBRARY.RU Режим доступа: https://elibrary.ru/defaultx.asp
- 5. Мировая цифровая библиотека. Режим доступа: http://wdl.org/ru/
- 6. Открытое образование. Курсы ведущих ВУЗов России. Режим доступа: http://openedu.ru/
- 7. Единое окно доступа к образовательным ресурсам. Режим доступа: http://window.edu.ru/

8. Большие данные https://habrahabr.ru/hub/bigdata

## д) программное обеспечение:

- 1. Microsoft Office (лицензионное ПО);
- 2. LibreOffice (свободно распространяемое ПО);
- 3. Doctor Web (лицензионное ПО).

## 7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

$\mathcal{N}\!\underline{o}\mathcal{N}\!\underline{o}$	Наименование оборудованных учебных кабинетов, объектов для проведения занятий			
П/П	с перечнем основного оборудования			
1	Мультимедийные лекционные аудитории. Оборудование: доска, ноутбук, проектор,			
1	экран.			
2	Учебные аудитории для проведения практических занятий, групповых и индивиду-			
2	альных консультаций, оборудованные доской, столами, стульями.			
	Учебные аудитории для организации и проведения самостоятельной работы сту-			
3	дентов, оборудованные доской, компьютерами с возможностью подключения к сети			
	«Интернет», столами, стульями.			

### МИНОБРНАУКИ РОССИИ

Глазовский инженерно-экономический институт (филиал) федерального государственного бюджетного образовательного учреждения высшего образования «Ижевский государственный технический университет имени М.Т. Калашникова»

# ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

по дисциплине «Эконометрика»

направление: 38.03.01 – Экономика

профиль: Экономика и управление

уровень образования: бакалавр

форма обучения: очно-заочная

общая трудоемкость дисциплины составляет 5 зачетных единиц

### 1. Оценочные средства

Оценивание формирования компетенций производится на основе результатов обучения, приведенных в п.2 рабочей программы и ФОС. Связь разделов компетенций, индикаторов и форм контроля (текущего и промежуточного) указаны в таблице 4.2 рабочей программы дисциплины.

Оценочные средства соотнесены с результатами обучения по дисциплине и индикаторами достижения компетенций представлены ниже.

№ п/п Коды компетенции		Результат обучения	Формы промежу-
	и индикаторов	(знания, умения и навыки)	точного контроля
1	и индикаторов  ОПК-2 Способен осуществлять сбор, обработку и стати- стический анализ данных, необходи- мых для решения по- ставленных экономи- ческих задач.	Знания:  31 Основные понятия эконометрики.  32 Основные эконометрические модели, используемых для анализа и оценки развития экономических и социальных систем  33 Сущность и особенности применения основных методов оценки параметров модели, проверки качества параметров модели и самой модели в целом.  Умения:  У1 Проводить вычисление различных статистических и эконометрических показателей  У2 Построить на основе имеющейся статистической информации «наилучшую» эконометрическую модель, определять на основе экономических законов вид спецификации модели  У3 Правильно интерпретировать построенную модель и сформулировать выводы, вытекающие из ее интерпретации  Навыки:  Н1 Владения методикой проведения экономических исследований  Н2 Владения методикой построения эконометрических моделей  Н3 Использования статистических пакетов для проведения расчетов, статистических таблиц, анализировать полученный результат с экономической, статистической и содержательной то-	Защита лабораторных работ, Дифференцированный зачет

Описание элементов для оценивания формирования компетенций

Наименование: Дифференцированный зачет

Представление в ФОС: примерный вариант зачетного билета; перечень вопросов к зачету.

## Примерный зачетный билет

iipiiepiibii sa teriibii onater				
	Варианты ответов			
Какое определение соответствует понятию эконометрика?	А) это наука, предметом изучения которой является количественная сторона массовых социально- экономических явлений и процессов в конкретных			

Какова цель эконометрики?	условиях места и времени Б) это наука, предметом изучения которой является количественное выражение взаимосвязей экономических явлений и процессов В) это наука. Предметом изучения которой являются общие закономерности случайных явлений и методы количественной оценки влияния случайных факторов. а) представить экономические данные в наглядном виде; б) разработать способы моделирования и количественного анализа реальных экономических объектов; в) определить способы сбора и группировки статистических данных; г) изучить качественные аспекты экономических явлений.
Коэффициент автокорреляции характеризует тесноту связи.	А) Обратной Б) Эконометрической В) Линейной Г) Нелинейной
Регрессионный анализ заключается в определении	А) аналитической формы связи, в которой изменение результативного признака обусловлено влиянием одного или нескольких факторных признаков, а множество всех прочих факторов, также оказывающих влияние на результативный признак принимается за постоянные и средние значения; Б) тесноты связи между двумя переменными (при парной связи) и между результативным и множеством факторных признаков (при многофакторной связи); В) статистической меры взаимодействия двух случайных переменных; Г) степени статистической связи между порядковыми переменными.
Какое значение не может принимать коэффициент корреляции?	A) -0,973
При каком значении линейного коэффициента корреляции связь между признаками можно считать сильной?	A) -0,975
Какой критерий используют для оценки значимости коэффициента корреляции?  Если парный коэффициент корреляции	А) F- критерий Фишера Б) t – критерий Стьюдента В) критерий Пирсона Г) критерий Дарбина -Уотсона А) отсутствие связи Б) наличие обратной корреляционной связи
равен ( – 1), то это означает	В) наличие обратной функциональной связи Г) наличие прямой функциональной связи
Согласно методу наименьших квадратов МНК минимизируется следующее выражение:	A) $\sum (y - \hat{y})^2$
В уравнении линейной парной регрессии $\hat{y} = a + bx$ параметр $b$ означает	А) усредненное влияние на результативный признак неучтенных факторов Б) среднее изменение результативного признака при изменении факторного признака на 1% В) на какую величину в среднем измениться результативный признак, если переменную х увеличить на единицу измерения Г) какая доля вариации результативного признака учтена в модели и обусловлена влиянием на нее пере-

	менной х		
Гетероскедастичность это	А) нарушение условия нормальности случайного чле-		
1	на;		
	Б) нарушение одинаковой распределенности случай-		
	ного члена.		
Уравнение регрессии имеет вид	А) увеличиться на 2,02		
$\hat{y} = 2,02+0,78x$ На сколько единиц своего	Б) увеличиться на 0,78 В) 2.8		
измерения в среднем измениться у при	В) увеличиться на 2,8 Г) не изменится		
увеличении х на единицу своего измерения?	1) no nameminos		
Какой коэффициент определяет среднее из-	А) коэффициент регрессии		
менение результативного признака при из-	Б) коэффициент детерминации		
менении факторного признака на 1%?	В) коэффициент корреляции		
	Г) коэффициент эластичности		
Что означает F- статистика в тесте Глейзе-	А) эффективность оценки;		
pa?	Б) значимость объясняющих переменных.		
Уравнение степенной функции имеет вид:	A) $\hat{y} = a \cdot x^b$ B) $\hat{y} = a + \frac{b}{x}$		
	B) $\hat{y} = a + b_1 x + b_2 x^2$ $\Gamma$ ) $\hat{y} = a \cdot b^x$		
Выделите условия Гаусса-Маркова	А) дисперсия случайного члена постоянна для всех наблюдений;		
	Б) в любых двух наблюдениях не должно быть систе-		
	матической связи между значениями случайного чле-		
	Ha;		
	В) случайный член должен иметь постоянное ненулевое математическое ожидание.		
Тест Дарбина – Уотсона применяется	А) для обнаружения недостающих регрессоров;		
	Б) выявления порядка автокорреляции;		
T	В) выявления автокорреляции.		
Из перечисленных моделей выберите ре-	a) 2,4		
грессионные модели с одним уравнением:	6) 1,4		
1) модель цены от объема поставки;	в) 2,3		
2) модель спроса и предложения;	г) все		
3) модель тренда и сезонности;			
4) модель зависимости объема производства			
от производственных факторов.			

#### Вопросы к зачету

- 1. Математическая и эконометрическая модель. Типы моделей. Типы данных.
- 2. Понятие о функциональной, статистической и корреляционных связях. Основные задачи прикладного корреляционно-регрессионного анализа.
- 3. Уравнение регрессии, его смысл и назначение.
- 4. Парная регрессия.
- 5. Метод наименьших квадратов.
- 6. Нелинейные модели регрессии и их модернизация.
- 7. Оценивание и интерпретация модели линейной регрессии (Л.Р.). Коэффициент детерминации  $\mathbb{R}^2$ .
- 8. Свойства коэффициентов регрессии и проверка гипотез (t-тест, F-тест).
- 9. Классическая линейная модель множественной регрессии (КЛММР).
- 10. Определение параметров уравнения методом наименьших квадратов.
- 11. Статистические свойства МНК оценок.
- 12. Анализ вариации зависимой переменной в регрессии. Коэффициенты  $R^2$  и скорректированный  $R^2$ .

- 13. Оценка качества модели множественной линейной регрессии: F-критерий Фишера, t-критерий Стьюдента.
- 14. Обобщенная линейная модель множественной регрессии. Обобщенный метод наименьших квадратов.
- 15. Гетероскедастичность: понятие, последствия, обнаружение. Корректировка модели.
- 16. Автокорреляция остатков. Критерий Дарбина Уотсона. Корректировка модели.
- 17. Мультиколлинеарность. Методы устранения.

Критерии оценки приведены в разделе 2.

## 2. КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ УРОВНЯ ОСВОЕНИЯ КОНТРОЛИРУЕМОГО МАТЕРИАЛА

		Вид, форма	д, форма Уровень освоения контролируемого материала			
Компетенции	Дескрипторы	оценочного ме-	отлично	хорошо	удовлетворительно	неудовлетворительно
		роприятия				
	Знает:		l -	заслуживает обучающий-	, ,	выставляется обучаю-
ОПК-2	31-33		**	ся, обнаруживший полное	* *	
	Умеет:	T	•	знание учебного материа-	•	
	У1-У3	Дифферен-		ла, усвоивший основную		
	Владеет навыками:	цированный	знание учебного мате-	литературу, рекомендо-	ме, необходимом для	учебного материала.
	H1-H3	зачет	риала, предусмотрен-		дальнейшей учебы и	
			* *	Оценка "хорошо" выстав-	•	-
			усвоивший основную	ляется обучающимся, по-		
			литературу и знако-		основной литературой,	
				ский характер знаний по	= =	
			литературой, рекомен-		граммой. Оценка вы-	
			дованной программой.	способным к их самостоя-	ставляется обучающим-	окончании образова-
				тельному пополнению и		J 1
				обновлению в ходе даль-	*	
				нейшей учебной работы и	=	
				профессиональной дея-	нении экзаменационных	ваемой дисциплине.
				тельности.	заданий, но обладаю-	
					щим необходимыми	
					знаниями для их устра-	
					нения под руководством	
					преподавателя.	

		Вид, форма	Уровень освоения контролируемого материала		
Компетенции	Дескрипторы	оценочного ме-	Зачтено	Незачтено	
		роприятия			
	Знает:		Правильно выполнена большая часть зада-	Задания выполнены менее чем на 80%.	
ОПК-2	31-33	Защита лабо-	ний (более 80%). Присутствуют незначи-	Продемонстрирован недостаточный уро-	
	Умеет:	раторной ра-	тельные ошибки. Продемонстрирован хо-	вень владения материалом.	
	У1-У3 боты		роший уровень владения материалом. Про-		
Владеет навыками: H1-H3			явлены хорошие способности применять		
			знания и умения к выполнению конкрет-		
			ных заданий.		