

**ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА ДЛЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ
ОБУЧАЮЩИХСЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ (МОДУЛЮ)**

1. Общие сведения

1.	Кафедра	Экономики и управления
2.	Направление подготовки	38.03.01 Экономика
3.	Направленность (профиль)	Финансы и кредит
4.	Дисциплина (модуль)	Эконометрика
5.	Форма обучения	очная
6.	Год набора	2021

2. Перечень компетенций

- | |
|---|
| <p>– УК-2: Способен определять круг задач в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений.</p> |
|---|

3. Критерии и показатели оценивания компетенций на различных этапах их формирования

Этап формирования компетенции (разделы, темы дисциплины)	Формируемая компетенция	Критерии и показатели оценивания компетенций			Формы контроля сформированности компетенций
		Знать:	Уметь:	Владеть:	
Тема 1 Основные аспекты эконометрического моделирования. Модели парной регрессии.	УК-2	основные понятия дисциплины; средства и методы эконометрических исследований; применение парной регрессии и корреляции в экономических исследованиях;	строить эконометрические модели задач, приводить их к нужному виду; проводить расчеты с использованием современных информационных технологий;	способностью на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и эконометрические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты;.	Тест Лабораторная работа ИДЗ
Тема 2 Множественный регрессионный анализ.	УК-2	средства и методы эконометрических исследований; применение множественной регрессии и корреляции в экономических исследованиях;	проводить проверку различных статистических гипотез; содержательно интерпретировать результаты построенной модели;	владеть методами множественного регрессионного анализа	Тест Лабораторная работа ИДЗ
Тема 3 Практические аспекты использования регрессионных моделей	УК-2	мультиколлинеарность линейные регрессионные модели с переменной структурой; нелинейные модели регрессии	использовать при решении профессиональных задач линейные регрессионные модели с переменной структурой, осуществлять линеаризацию нелинейных моделей	навыками использования регрессионных моделей для решения задач в своей профессиональной деятельности	Тест Лабораторная работа ИДЗ
Тема 4 Анализ временных рядов, прогнозирование.	УК-2	средства и методы эконометрических исследований; основы моделирования и анализа временных рядов;	прогнозировать значение результативного признака;	навыками анализа временных рядов и прогнозирования значений экономических показателей	Тест Лабораторная работа ИДЗ
Тема 5 Системы одновременных уравнений.	УК-2	основы моделирования и анализа временных рядов;	использовать при решении профессиональных задач системы одновременных уравнений	навыками описания экономических процессов с помощью систем одновременных уравнений	Тест Лабораторная работа ИДЗ

Шкала оценивания в рамках балльно-рейтинговой системы: «не зачтено» – 60 баллов и менее; «зачтено» – 61-100 баллов.

4. Критерии и шкалы оценивания

4.1 Тест

Процент правильных ответов	До 60	61-80	81-100
Количество баллов за решенный тест	1	2	3

4.2 Индивидуальное домашнее задание (ИДЗ)

Баллы	Характеристика индивидуального домашнего задания
4	Уровень расчетно-графической работы отвечает всем требованиям, предъявляемым к выполнению ИДЗ, теоретическое содержание раздела дисциплины «Эконометрика» освоено полностью, необходимые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы, все предусмотренные программой обучения задания ИДЗ выполнены без замечаний.
3	Уровень расчетно-графической работы отвечает всем требованиям, предъявляемым к выполнению ИДЗ, теоретическое содержание раздела дисциплины «Эконометрика» освоено полностью, при этом некоторые практические навыки работы с освоенным материалом сформированы недостаточно, но все предусмотренные программой обучения задания ИДЗ выполнены, некоторые из них содержат негрубые ошибки.
2	Уровень расчетно-графической работы не отвечает большинству требований, предъявляемым к выполнению ИДЗ, теоретическое содержание раздела дисциплины «Эконометрика» освоено частично, некоторые практические навыки работы не сформированы, отдельные предусмотренные программой обучения задания ИДЗ выполнены с грубыми ошибками.
0	Уровень выполнения ИДЗ показывает, что теоретическое содержание раздела дисциплины «Эконометрика» не освоено, необходимые практические навыки работы не сформированы, все выполненные задания ИДЗ содержат грубые ошибки, дополнительная самостоятельная работа над материалом не приведет к какому-либо значимому повышению качества выполнения заданий ИДЗ.

Требования, предъявляемые к выполнению ИДЗ:

ИДЗ должно базироваться на знаниях теоретических и методических вопросах дисциплины «Эконометрика». Работа должна содержать элементы творчества, новизны, направленные на эффективное решение заданий ИДЗ;

- ИДЗ должно отразить глубину теоретической подготовки студента, понимание контролируемого учебного материала по дисциплине «Эконометрика»: умение связывать теоретические положения с их практическим применением, способность самостоятельно формировать и обосновывать собственные выводы, логически и грамотно излагать свои мысли;
- в ИДЗ не допускается переписывание учебников, учебных пособий и других источников;
- Студент – автор ИДЗ полностью отвечает за предложенные решения заданий и правильность всех данных, приведенных в ИДЗ;
- ИДЗ должно быть сдано в назначенный руководителем срок.

4.3 Практическая работа

Баллы	Характеристика индивидуального домашнего задания
3	Полученные ранее знания для проведения анализа, опыта, эксперимента и выполнения последующих расчетов, а также составления выводов сформированы недостаточно. Лабораторная работа выполнена без замечаний.
2	Полученные ранее знания для проведения анализа, опыта, эксперимента и выполнения последующих расчетов, а также составления выводов сформированы. Лабораторная работа выполнена полностью, с небольшими без замечаниями.
1	Уровень выполнения лабораторной работы не отвечает большинству требований, теоретическое содержание раздела дисциплины освоено частично, некоторые практические навыки работы не сформированы.
0	Уровень выполнения лабораторной работы, что теоретическое содержание раздела дисциплины, необходимые практические навыки не сформированы.

5. Типовые контрольные задания и методические материалы, определяющие процедуры оценивания знаний, умений, навыков и (или) опыта деятельности, характеризующих этапы формирования компетенций в процессе освоения образовательной программы.

5.1. Типовой тест

Тема 1 Основные аспекты эконометрического моделирования. Модели парной регрессии.

1. Под эконометрикой в широком смысле слова понимается:

- а) совокупность теоретических результатов;
- б) совокупность различного рода экономических исследований, проводимых с использованием математических методов;
- в) самостоятельная научная дисциплина;
- г) применение статистических методов;

2. Экономико-математическая модель-это:

- а) модель, описывающая механизм функционирования экономики;
- б) математическое описание экономического объекта или процесса с целью их исследования и управления ими;
- в) экономическая модель;
- г) модель реального явления;

3. Если все наблюдения лежат на линии регрессии, то коэффициент детерминации R^2 для модели парной регрессии равен:

- а) нулю;
- б) $2/3$;
- в) единицы;
- г) $1/2$;
- д) 0;

4. Какие переменные существуют в эконометрике:

- а) экзогенные, эндогенные;
- б) предопределенные, эндогенные;
- в) экзогенные, эндогенные, предопределенные;
- г) внешние, внутренние;

5. Основные типы эконометрических моделей:

- а) модели тренда, модель сезонности;
- б) модель временных рядов, регрессионные модели, система одновременных уравнений;
- в) регрессионная, модель тренда и сезонности;
- г) модель сезонности, регрессионная;

Тема 2 Множественный регрессионный анализ.

6. Множественная регрессия-это:

- а) модель, где среднее значение зависимой переменной Y рассматривается как функция нескольких независимых переменных X_1, X_2, X_3 ;
- б) зависимость среднего значения какой-либо величины;
- в) модель, где среднее значение зависимой переменной Y рассматривается как функция одной независимой X ;
- г) модель вида $Y=a+bx$;

7. МНК автоматически дает _____ для данной выборки значение коэффициента детерминации R^2 :

- а) минимальное;
- б) максимальное;
- в) среднее;
- г) средневзвешенное;
- д) случайное;

Тема 3 Практические аспекты использования регрессионных моделей

8. Фиктивная переменная взаимодействия – это _____ фиктивных переменных:

- а) произведение;
- б) среднее;
- в) разность;
- г) сумма;

д) отношение;

9. Зависимая переменная может быть представлена как фиктивная в случае если она:

- а) подвержена сезонным колебаниям;
- б) имеет трендовую составляющую;
- в) является качественной по своему характеру;
- г) трудноизмерима;
- д) не подвержена сезонным колебаниям;

Тема 4 Анализ временных рядов, прогнозирование

10. Как выражается модель тренда и сезонности:

- а) $y(t)=T(t)- S(t)+ Et$
- б) $y(t)=T(t)+ S(t)+ Et$
- в) $y(t)=T(t)+ S(t)- Et$
- г) $y(t)=T(t)- S(t)- Et$

11. При автокорреляции оценка коэффициентов регрессии становится:

- а) смещенной;
- б) невозможной;
- в) неэффективной;
- г) равной 0;
- д) равной максимальному значению;

Тема 5 Системы одновременных уравнений

12. Одно из условий идентифицируемости системы одновременных уравнений (COУ) состоит в том, что:

- а) переменные являются коллинеарными;
- б) число уравнений равно числу анализируемых эндогенных переменных;
- в) переменные являются компланарными;
- г) число уравнений меньше числа анализируемых эндогенных переменных.

13. Косвенный метод наименьших квадратов применим для ...

- а) идентифицируемой системы одновременных уравнений;
- б) неидентифицируемой системы рекурсивных уравнений ;
- в) неидентифицируемой системы уравнений;
- г) любой системы одновременных уравнений;

Ключи:

Тема	Тестовое задание	
	Номер теста	Правильный вариант ответа
Тема 1 Основные аспекты эконометрического моделирования. Модели парной регрессии.	1	б
	2	б
	3	в
	4	в
	5	б
Тема 2 Множественный регрессионный анализ.	6	а
	7	б
Тема 3 Практические аспекты использования регрессионных моделей	8	а
	9	г
Тема 4 Анализ временных рядов, прогнозирование.	10	б
	11	в
Тема 5 Системы одновременных уравнений.	12	г
	13	а

5.2. Типовое индивидуальное домашнее задание

В некотором магазине в течение часа производился опрос покупателей: у каждого покупателя спрашивался его возраст (количество полных лет). Были получены следующие данные:

Полных лет	18	19	21	23	24	25
Человек	4	1	5	3	2	1

Требуется найти средний возраст покупателей, построить полигон относительных частот.

Решение:

В данной задаче имеет место **дискретная случайная величина – возраст покупателя.**

Обозначим эту случайную величину X .

В первой строке таблицы находятся *варианты* – возможные значения случайной величины X , во второй строке находятся *частоты*.

Для того, чтобы построить требуемые графики, необходимо будет найти относительные частоты и накопленные относительные частоты.

$W_i = \frac{n_i}{n}$ - относительные частоты; $F_i = \sum_{k=0}^i W_k$ - накопленные относительные частоты;

n_i - частоты; n - общее количество наблюдений, оно равно сумме всех наблюдений.

Находить средний возраст покупателей в данной задаче следует по формуле *арифметической средней взвешенной*:

$$\bar{X} = \frac{\sum_{i=1}^n x_i n_i}{\sum_{i=1}^n n_i}$$

Выполнение задания с помощью приложения MS Excel:

1. Запустите приложение MS Excel;
2. В верхней части первого листа создайте таблицу с исходными данными так, как это показано на рисунке ниже:

	A	B	C	D	E	F	G
1	полных лет x_i	18	19	21	23	24	25
2	человек n_i	4	1	5	3	2	1
3	относительные частоты						
4	накопленные относительные частоты						
5	$x_i * n_i$						
6	средний возраст						
7	объем выборки						

1. Вычислим объем выборки: установите курсор в ячейку B7 и введите формулу: =СУММ(B2:G2);
2. Найдем средний возраст покупателей, по формуле средневзвешенной. Установите курсор в ячейку B5, введите: =B1*B2. Скопируйте формулу по строке. Установите курсор в ячейку B6 и введите формулу: =СУММ(B5:G5)/B7;
3. Вычислим относительные частоты. Установите курсор в ячейку B3 и введите формулу: =B2/\$B\$7. Скопируйте эту формулу в диапазон ячеек C3:G3.
4. Вычислим накопленные относительные частоты:
 - a. Введите в ячейку B4 формулу: =B3;
 - b. В ячейку C4 введите формулу: =B4+C3;
 - c. Скопируйте формулу из ячейки C4 в диапазон ячеек D4:G4;
5. Если все выполнено верно, то таблица должна выглядеть следующим образом:

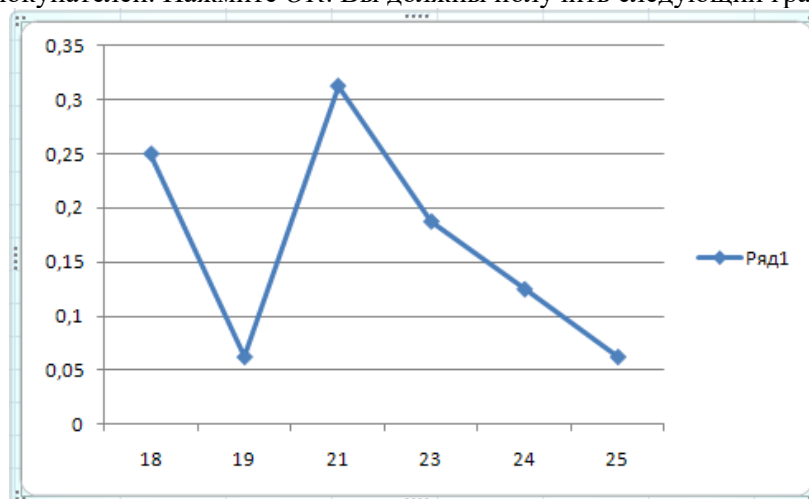
	A	B	C	D	E	F	G
1	полных лет x_i	18	19	21	23	24	25
2	человек n_i	4	1	5	3	2	1
3	относительные частоты	0,25	0,0625	0,3125	0,1875	0,125	0,0625
4	накопленные относительные частоты	0,25	0,3125	0,625	0,8125	0,9375	1
5	$x_i \cdot n_i$	72	19	105	69	48	25
6	средний возраст	21,125					
7	объем выборки	16					

6. Построим полигон относительных частот. Для этого нам нужно построить график на основании данных, находящихся в диапазоне В3:G3. Выделите этот диапазон и выполните следующие действия:

а. Выполните пункт меню *Вставка/График*;

б. В открывшемся диалоговом окне выберите: вид диаграммы – график с маркерами. Нажмите *Далее*.

с. На ленте найдите команду «выбрать данные». В диалоговом окне, в правой части найдите «Подписи горизонтальной оси», и выберите команду «изменить». Задайте в этом поле диапазон В1:G1. Это означает, что по оси X будут подписаны данные из первой строки таблицы, то есть будет указан возраст покупателей. Нажмите *ОК*. Вы должны получить следующий график:



Задание 2

В магазине в течение 10 дней подсчитывали количество проданного товара заданного вида. В результате были получены следующие данные:

12	15	16	12	17	11	15	12	10	12
----	----	----	----	----	----	----	----	----	----

Для полученного вариационного ряда определить:

- Размах ряда;
- Среднее значение;
- Дисперсию;
- Среднее квадратическое отклонение;
- Коэффициент вариации;
- Медиану;
- Моду.

Решение:

В данной задаче имеет место несгруппированный вариационный ряд.

Размах ряда определяется по формуле: $R = \frac{x_{\max} - x_{\min}}{2}$.

Дисперсия – мера разброса случайной величины, определяется по следующей формуле:

$$\sigma_B^2 = \frac{\sum_{i=1}^n (x_i - \bar{x}_B)^2}{n}$$

Среднее квадратическое (или стандартное) отклонение $\sigma_B = \sqrt{\sigma_B^2}$. Основной мерой статистического измерения изменчивости признака у членов совокупности служит среднее квадратическое отклонение (σ)(сигма) или, как часто ее называют, стандартное отклонение. Теория вариационной статистики показала, что для характеристики любой генеральной совокупности, имеющей нормальный тип распределения достаточно знать два параметра: среднюю арифметическую и среднее квадратическое отклонение. Эти параметры заранее не известны и их оценивают с помощью выборочной средней арифметической и выборочного стандартного отклонения, которые вычисляются при обработке случайной выборки.

Свойства среднего квадратического (стандартного) отклонения:

1. Стандартное отклонение всегда измеряется в тех же единицах измерения, что и основные варианты.

2. Чем больше (σ), тем больше изменчивость признака.

3. В вариационных рядах с нормальным распределением частот 99,7% всех членов совокупности находящихся в границах от x_1 до x_2 , которые отстоят от средней арифметической на величину от -3σ до $+3\sigma$. За пределами $\pm 3\sigma$ находятся только 0,3% всех членов совокупности.

4. При вычислении стандартное отклонение определяют с точностью на один десятичный знак больше, чем точность, которую применяют для вычисления средней арифметической для того же ряда.

Коэффициент вариации. Характеристики совокупности, такие как средние арифметическое и среднее квадратическое отклонение имеют один недостаток: они дают показатель изменчивости признака в именованных величинах, а не в относительных. Поэтому сопоставление (или сравнение) разноименных признаков по этим параметрам невозможно.

В этом случае удобно пользоваться коэффициентом изменчивости признака, который выражается в относительных величинах, а именно в процентах, и вычисляется по формуле:

$$V = \frac{\sigma_B}{\bar{x}_B} \cdot 100\%$$

Чем больше V, тем более изменчив признак. Значения коэффициента вариации, невыходящие за пределы 10%, принято считать нормальными. Если $V > 20\%$, то выборка некомпактна по заданному признаку.

Моду и медиану находят в ранжированном ряде (отсортированном по возрастанию или убыванию).

Медианой называется значение признака, которое лежит в середине ранжированного ряда и делит этот ряд на две равные по численности части. Если выборка содержит четное число членов, то медианой в этом случае принято среднее арифметическое значений, расположенных в центре ряда.

Мода – такая величина признака в изучаемом вариационном ряду, которая встречается чаще всего.

Выполнение задания с помощью приложения MS Excel:

1. Запустите приложение MS Excel, откройте тот файл, в котором выполнялось предыдущее задание, и перейдите на второй лист;
2. В верхней части первого листа создайте таблицу с исходными данными так, как это показано на рисунке ниже:

	A	B	C	D	E
1	<i>Продано товара, xi</i>	$(Xi-X_{ср})^2$		<i>Дисперсия</i>	
2	12			<i>Средн.кв. откл.</i>	
3	15			<i>Козф. вариаци.</i>	
4	16				
5	12				
6	17				
7	11				
8	15				
9	12				
10	10				
11	12				
12					
13	<i>Макс. знач.</i>				
14	<i>Мин. знач.</i>				
15	<i>Средн. знач.</i>				
16	<i>Размах ряда</i>				

- Найдем максимальное значение признака. Установите курсор в ячейку B13 и введите формулу: =МАКС(A2:A11);
- Аналогичным образом в ячейке B4 определите минимальное значение признака (функция МИН(диапазон ячеек));
- В ячейке B15 найдите среднее значение признака, используя функцию СРЗНАЧ(диапазон ячеек);
- В ячейке B16 вычислим размах ряда по формуле: =(B13-B14)/2.
- Найдем дисперсию, для этого проведем дополнительные вычисления.
 - Установите курсор в ячейку B2 и введите формулу: =СТЕПЕНЬ((A2-\$B\$15);2). Скопируйте эту формулу вниз в диапазон ячеек B3:B11.
 - Теперь можно вычислить саму дисперсию. Установите курсор в ячейку E1 и введите формулу: =СУММ(B2:B11)/10;
- Вычислим среднее квадратическое отклонение. Установите курсор в ячейку E2 и введите формулу: =КОРЕНЬ(E1);
- Вычислим коэффициент вариации. Курсор в ячейку E3 и введите формулу: =E2/B15. Установите для этой ячейки процентный формат (*Вид/Формат ячейки*, в открывшемся диалоговом на первой вкладке *Число* выбрать *Вид – Процентный*);
- В итоге таблица с вычислениями должна иметь следующий вид:

	A	B	C	D	E
1	<i>Продано товара, xi</i>	$(Xi-X_{ср})^2$		<i>Дисперсия</i>	4,96
2	12	1,44		<i>Средн.кв. откл.</i>	2,23
3	15	3,24		<i>Козф. вариаци.</i>	16,87%
4	16	7,84			
5	12	1,44			
6	17	14,44			
7	11	4,84			
8	15	3,24			
9	12	1,44			
10	10	10,24			
11	12	1,44			
12					
13	<i>Макс. знач.</i>	17			
14	<i>Мин. знач.</i>	10			
15	<i>Средн. знач.</i>	13,2			
16	<i>Размах ряда</i>	3,5			
17					

- Вычислим значение дисперсии с помощью встроенной функций MS Excel. Установите курсор в ячейку F1 и введите формулу: =ДИСПР(A2:A11). Данная функция позволяет вычислить дисперсию выборки. Вычисленное значение должно совпасть с тем, что вы получили при вычислениях «вручную».
- Для поиска медианы ряд его нужно ранжировать, то есть отсортировать. Отсортируем ряд по возрастанию. Установите курсор в ячейку A1 и выполните пункт меню *Данные/Сортировка...* В открывшемся диалоговом окне должен стоять флажок *Сортировать по возрастанию*, нажмите ОК. Обратите внимание, что вместе с первым столбцом будет соответственно отсортирован и второй столбец. Значения вычисленных величин **не изменятся**.
- Дополнительно оформите таблицу на листе так, как это показано на рисунке ниже:

	C	D	E	F
		<i>Дисперсия</i>	4,96	4,96
		<i>Средн. кв. откл.</i>	2,23	
		<i>Козф. вариаци.</i>	16,87%	
		<i>Медиана</i>		
		<i>Мода</i>		

14. Установите курсор в ячейку E5 и введите формулу: =МЕДИАНА(A2:A11);

15. Установите курсор в ячейку E6 и введите формулу: =МОДА(A2:A11);

16. В результате всех вычислений, таблица должна иметь следующий вид:

	A	B	C	D	E	F
1	<i>Продано товара, xi</i>	$(Xi - X_{ср})^2$		<i>Дисперсия</i>	4,96	4,96
2	10	10,24		<i>Средн. кв. откл.</i>	2,23	
3	11	4,84		<i>Козф. вариаци.</i>	16,87%	
4	12	1,44				
5	12	1,44		<i>Медиана</i>	12	
6	12	1,44		<i>Мода</i>	12	
7	12	1,44				
8	15	3,24				
9	15	3,24				
10	16	7,84				
11	17	14,44				
12						
13	<i>Макс. знач.</i>	17				
14	<i>Мин. знач.</i>	10				
15	<i>Средн. знач.</i>	13,2				
16	<i>Размах ряда</i>	3,5				

5.3. Вопросы к зачету

1. Цели, задачи эконометрики.
2. Предмет эконометрики
3. Основные этапы эконометрического моделирования
4. Классификация эконометрических моделей.
5. Классификация видов эконометрических переменных.
6. Статистические характеристики числового ряда: размах ряда; среднее значение; дисперсия; среднее квадратическое отклонение; коэффициент вариации; медиана; мода.
7. Нормальное распределение.
8. Оценивание параметров случайной величины: выборочное среднее; выборочное среднее; квадратическое отклонение; стандартную ошибку; границы доверительных интервалов
9. Понятие статистической гипотезы, проверка статистической гипотезы.
10. Линейная парная регрессия. Вывод уравнения линейной регрессии с помощью МНК.
11. Статистическая корректность эконометрической модели.
12. Корреляционный анализ.
13. Проверка статистической значимости уравнения линейной регрессии с помощью критерия Фишера.
14. Оценка параметров уравнения с помощью критерия Стьюдента.
15. Оценка адекватности модели, ошибка аппроксимации.
16. Нелинейная парная регрессия, линеаризация уравнений.
17. Корреляционный анализ в случае нелинейной парной регрессии.
18. Интервалы прогноза по линейному уравнению регрессии. Построение доверительных интервалов
19. Множественная регрессия. Отбор факторов при построении множественной регрессии
20. Матрица парных корреляций. Мультиколлинеарность
21. Оценка параметров уравнения множественной регрессии
22. Уравнение множественной регрессии в стандартизованном масштабе. Оценка коэффициентов B_i
23. Переход от уравнения множественной регрессии в натуральном масштабе к уравнению в стандартизованном масштабе и обратно
24. Частные уравнения регрессии
25. Множественная корреляция
26. Частные коэффициенты корреляции
27. Компонентный анализ временных рядов.
28. Определение тренда.
29. Метод скользящего среднего.
30. Автокорреляция.