

Документ подписан простой электронной подписью.
Информация о владельце:

ФИО: Кандрашина Елена Александровна

Должность: И.о. ректора ФГАОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»

Дата подписания: 22.07.2024 14:34:06

Уникальный программный ключ:

2db64eb9605ce27edd3b8e8fdd32c70e0674ddd2

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«Самарский государственный экономический университет»

Институт Институт национальной и мировой экономики

Кафедра Статистики и эконометрики

УТВЕРЖДЕНО

Ученым советом Университета

(протокол № 10 от 30 мая 2024 г.)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Наименование дисциплины Б1.О.06 Эконометрика (продвинутый уровень)

Основная профессиональная образовательная программа 38.04.01 Экономика программа Аналитика в бизнесе и государственном управлении

Квалификация (степень) выпускника магистр

Самара 2024

Содержание (рабочая программа)

Стр.

- 1 Место дисциплины в структуре ОП
- 2 Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе
- 3 Объем и виды учебной работы
- 4 Содержание дисциплины
- 5 Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины
- 6 Фонд оценочных средств по дисциплине

Целью изучения дисциплины является формирование результатов обучения, обеспечивающих достижение планируемых результатов освоения образовательной программы.

1. Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина Эконометрика (продвинутый уровень) входит в обязательную часть блока Б1. Дисциплины (модули)

Предшествующие дисциплины по связям компетенций: Современные проблемы экономической науки, Методы и модели поддержки принятия решений (в профессиональной области), Логические методы анализа данных

Последующие дисциплины по связям компетенций: Предиктивная аналитика в экономике, Непараметрические методы анализа, Количественные методы обработки данных, Комплексы электронной обработки социально-экономической информации

2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Изучение дисциплины Эконометрика (продвинутый уровень) в образовательной программе направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-1 - Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач;

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОПК-1	ОПК-1.1: Знать:	ОПК-1.2: Уметь:	ОПК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	современное состояние мировой экономики и особенности функционирования российских рынков; показатели, характеризующие развитие национальной экономики и принципы их расчёта; методику анализа и прогнозирования экономических явлений и процессов	высказывать и обосновывать свою позицию по вопросам экономического развития общества; использовать понятийный аппарат экономической науки для описания экономических и финансовых процессов; обрабатывать данные финансовой, бухгалтерской и статистической отчётности, анализировать, оценивать и интерпретировать полученные результаты	экономическими методами анализа социально значимых проблем и процессов; методикой построения, анализа и применения теоретических моделей для оценки состояния экономических процессов и явлений; навыками расчёта на основе статистических данных показателей развития социальноэкономических процессов

ОПК-2 - Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях;

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ОПК-2	ОПК-2.1: Знать:	ОПК-2.2: Уметь:	ОПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	сущность, основные принципы и этапы	подготавливать исходные данные, необходимые для	навыками применения математического

	экономического анализа; методы построения математико-статистических моделей объектов, процессов и явлений; основы статистики и теории вероятностей	расчёта экономических показателей; обосновывать выбор методик расчёта экономических показателей; прогнозировать поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений на макро- и микроуровнях	инструментария для решения экономических задач; методами и приёмами анализа экономических явлений и процессов с помощью математико-статистических моделей; навыками интерпретации результатов экономического анализа хозяйствующих субъектов
--	--	--	--

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен разрабатывать и применять инструментарий выявления и описания статистических закономерностей с помощью методов математической статистики

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
ПК-2	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	методы математического анализа и статистики; принципы работы, область применения и принципиальные ограничения методов и инструментов статистического анализа экономических данных; основные закономерности, которым подчиняются массовые случайные явления	применять методы математического и статистического анализа для решения экономических задач; осуществлять мониторинг соответствия инструментов обработки экономических данных поставленным задачам; применять различные подходы к прогнозированию экономических явлений	навыками применения математического инструментария для решения экономических задач; инструментарием анализа и интерпретации данных статистики; навыками работы с нечисловыми данными

3. Объем и виды учебной работы

Учебным планом предусматриваются следующие виды учебной работы по дисциплине:

Очная форма обучения

Виды учебной работы	Всего час/ з.е.
	Сем 2
Контактная работа, в том числе:	22.3/0.62
Занятия лекционного типа	8/0.22
Занятия семинарского типа	12/0.33
Индивидуальная контактная работа (ИКР)	0.3/0.01
Групповая контактная работа (ГКР)	2/0.06
Самостоятельная работа:	195.7/5.44
Промежуточная аттестация	34/0.94
Вид промежуточной аттестации:	
Экзамен	Экз
Общая трудоемкость (объем части образовательной программы): Часы	252
Зачетные единицы	7

4. Содержание дисциплины

4.1. Разделы, темы дисциплины и виды занятий:

Тематический план дисциплины Эконометрика (продвинутый уровень) представлен в таблице.

Разделы, темы дисциплины и виды занятий Очная форма обучения

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контактная работа				Самостоятельная работа	Планируемые результаты обучения в соотношении с результатами обучения по образовательной программе	
		Лекции	Занятия семинарского типа		ИКР			ГКР
			Практич. занятия					
1.	Модели временных рядов	4	6			98	ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	
2.	Программные средства эконометрического моделирования	4	6			97,7	ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	
	Контроль	34						
	Итого	8	12	0.3	2	195.7		

4.2 Содержание разделов и тем

4.2.1 Контактная работа

Тематика занятий лекционного типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия лекционного типа*	Тематика занятия лекционного типа
1.	Модели временных рядов	лекция	Анализ временных рядов
		лекция	Методология эконометрического прогноза
2.	Программные средства эконометрического моделирования	лекция	Статистические пакеты, их сравнительная характеристика
		лекция	Особенности практического использования пакетов прикладных программ

*лекции и иные учебные занятия, предусматривающие преимущественную передачу учебной информации педагогическими работниками организации и (или) лицами, привлекаемыми организацией к реализации образовательных программ на иных условиях, обучающимся

Тематика занятий семинарского типа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид занятия семинарского типа**	Тематика занятия семинарского типа
1.	Модели временных рядов	практическое занятие	Понятие и компоненты временного ряда
		практическое занятие	Автокорреляция временного ряда
		практическое занятие	Анализ структуры временного ряда
2.	Программные средства	практическое занятие	Возможности табличного процессора

	эконометрического моделирования		Excel
		практическое занятие	Пакет Statistica
		практическое занятие	Пакет SPSS

** семинары, практические занятия, практикумы, лабораторные работы, коллоквиумы и иные аналогичные занятия

Иная контактная работа

При проведении учебных занятий СГЭУ обеспечивает развитие у обучающихся навыков командной работы, межличностной коммуникации, принятия решений, лидерских качеств (включая при необходимости проведение интерактивных лекций, групповых дискуссий, ролевых игр, тренингов, анализ ситуаций и имитационных моделей, преподавание дисциплин (модулей) в форме курсов, составленных на основе результатов научных исследований, проводимых организацией, в том числе с учетом региональных особенностей профессиональной деятельности выпускников и потребностей работодателей).

Формы и методы проведения иной контактной работы приведены в Методических указаниях по основной профессиональной образовательной программе.

4.2.2 Самостоятельная работа

№п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Вид самостоятельной работы ***
1.	Модели временных рядов	- изучение литературы - выполнение практической работы - тестирование
2.	Программные средства эконометрического моделирования	- изучение литературы - выполнение практической работы - тестирование

*** самостоятельная работа в семестре, написание курсовых работ, докладов, выполнение контрольных работ

5. Материально-техническое и учебно-методическое обеспечение дисциплины

5.1 Литература:

Основная литература

Эконометрика : учебник для вузов / И. И. Елисеева [и др.] ; под редакцией И. И. Елисеевой. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 449 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-00313-0. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/535449>

Дополнительная литература

Евсеев, Е. А. Эконометрика : учебное пособие для вузов / Е. А. Евсеев, В. М. Буре. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2024. — 186 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-10752-4. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/539152>

Литература для самостоятельного изучения

1. Айвазян С.А. Методы эконометрики: Учебник - М.: Магистр: ИНФРА-М, 2010.
2. Айвазян С.А., Мхитарян В.С. Прикладная статистика и основы эконометрики: Учебник для вузов. - М.: ЮНИТИ, 2005.
3. Афанасьев В.Н., Юзбашев М.М., Гуляева Т.И. Эконометрика: Учебник. - М.: Финансы и статистика, 2006.
4. Бабешко Л.О. Основы эконометрического моделирования: Учебное пособие. - М.: URSS, 2007.
5. Берндт Э.Р. Практика эконометрики: классика и современность - М.: ЮНИТИ - ДАНА, 2005.
6. Бородич С.А. Эконометрика: Учеб. пособие. – Мн.: Новое знание, 2006.
7. Василенко В.П., Болотин И.Б. Математическое моделирование социально-экономических процессов: Практический курс для студентов специальностей менеджмент организаций и государственное и муниципальное управление. – Смоленск: Изд-во Смол. гос. ун-та, 2008.

8. Колемаев В.А. Математическая экономика: Учебник. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2005.
9. Кремер Н.Ш., Путко Б.А. Эконометрика. 3-е изд., перераб. и доп. Электронное издание. – МО РФ. М.: ЮНИТИ, 2010. URL: <http://ibooks.ru/reading.php?productid=24749>
10. Новиков А.И. Эконометрика: Учеб. пособие. - Электронное издание. М.: ИТК «Дашков и К°», 2013. URL: <http://ibooks.ru/product.php?productid=28880>
11. Репина Е.Г., Суханова Е.И. Практикум по эконометрике: парная регрессия. - Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2014.
12. Репина Е.Г., Ширяева Л.К. Практикум по эконометрике: кейс-задания - Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2014.
13. Суханова Е.И., Ширяева Л.К. Начальный курс эконометрики: руководство к решению задач [Текст]: Учебное пособие / Е. И. Суханова, Л. К. Ширяева. - 2-е изд. перераб. и доп., УМО. - Самара: Изд-во Самар. гос. экон. ун-та, 2012. - 200с.; 60x84/16. - (Учебная литература для вузов). - Библиогр.: с. 192. - ISBN 978-5-94622-390-4.

5.2. Перечень лицензионного программного обеспечения

1. Astra Linux Special Edition «Смоленск», «Орел»; РедОС
2. МойОфис Стандартный 2, МойОфис Образование, Р7-Офис Профессиональный

5.3 Современные профессиональные базы данных, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. Профессиональная база данных «Информационные системы Министерства экономического развития Российской Федерации в сети Интернет» (Портал «Официальная Россия» - <http://www.gov.ru/>)
2. Государственная система правовой информации «Официальный интернет-портал правовой информации» (<http://pravo.gov.ru/>)
3. Профессиональная база данных «Финансово-экономические показатели Российской Федерации» (Официальный сайт Министерства финансов РФ - <https://www.minfin.ru/ru/>)
4. Профессиональная база данных «Официальная статистика» (Официальный сайт Федеральной службы государственной статистики - <http://www.gks.ru/>)

5.4. Информационно-справочные системы, к которым обеспечивается доступ обучающихся

1. справочно-правовая система «Консультант Плюс»
2. справочно-правовая система «ГАРАНТ-Максимум»

5.5. Специальные помещения

Учебные аудитории для проведения занятий лекционного типа	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран
Учебные аудитории для проведения практических занятий (занятий семинарского типа)	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для групповых и индивидуальных консультаций	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Учебные аудитории для текущего контроля и промежуточной аттестации	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор

	Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для самостоятельной работы	Комплекты ученической мебели Мультимедийный проектор Доска Экран Компьютеры с выходом в сеть «Интернет» и ЭИОС СГЭУ
Помещения для хранения и профилактического обслуживания оборудования	Комплекты специализированной мебели для хранения оборудования

Для проведения занятий лекционного типа используются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия в виде презентационных материалов, обеспечивающих тематические иллюстрации.

6. Фонд оценочных средств по дисциплине Эконометрика (продвинутый уровень):

6.1. Контрольные мероприятия по дисциплине

Вид контроля	Форма контроля	Отметить нужное знаком « + »
Текущий контроль	Практические задания	+
	Тестирование	+
Промежуточный контроль	Экзамен	+

Порядок проведения мероприятий текущего и промежуточного контроля определяется Методическими указаниями по основной профессиональной образовательной программе высшего образования; Положением о балльно-рейтинговой системе оценки успеваемости обучающихся по основным образовательным программам высшего образования – программам бакалавриата, программам специалитета, программам магистратуры в федеральном государственном автономном образовательном учреждении высшего образования «Самарский государственный экономический университет».

6.2. Планируемые результаты обучения по дисциплине, обеспечивающие достижение планируемых результатов обучения по программе

Общепрофессиональные компетенции (ОПК):

ОПК-1 - Способен применять знания (на продвинутом уровне) фундаментальной экономической науки при решении практических и (или) исследовательских задач;

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ОПК-1.1: Знать:	ОПК-1.2: Уметь:	ОПК-1.3: Владеть (иметь навыки):
	современное состояние мировой экономики и особенности функционирования российских рынков; показатели, характеризующие развитие национальной	высказывать и обосновывать свою позицию по вопросам экономического развития общества; использовать понятийный аппарат экономической науки для описания экономических	экономическими методами анализа социально значимых проблем и процессов; методикой построения, анализа и применения теоретических моделей для оценки состояния экономических

	экономики и принципы их расчёта; методику анализа и прогнозирования экономических явлений и процессов	и финансовых процессов; обрабатывать данные финансовой, бухгалтерской и статистической отчётности, анализировать, оценивать и интерпретировать полученные результаты	процессов и явлений; навыками расчёта на основе статистических данных показателей развития социальноэкономических процессов
Пороговый	основы экономических явлений и процессов	систематизировать полученную экономическую информацию	навыками систематизации экономических фактов и явлений для решения прикладных задач
Стандартный (в дополнение к пороговому)	особенности, проблемы и закономерности современной экономики	анализировать и интерпретировать экономические явления и процессы в соответствии с базовыми экономическими категориями	методами анализа экономических процессов и явлений в различных сферах деятельности
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	способы применения знаний экономической теории при решении практических и исследовательских задач	строить теоретические и эконометрические модели в процессе описания экономических явлений; интерпретировать полученные результаты проведенного анализа.	навыками прогнозирования развития экономических процессов.

ОПК-2 - Способен применять продвинутые инструментальные методы экономического анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях;

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ОПК-2.1: Знать:	ОПК-2.2: Уметь:	ОПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	сущность, основные принципы и этапы экономического анализа; методы построения математико-статистических моделей объектов, процессов и явлений; основы статистики и теории вероятностей	подготавливать исходные данные, необходимые для расчёта экономических показателей; обосновывать выбор методик расчёта экономических показателей; прогнозировать поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений на макро- и микроуровнях	навыками применения математического инструментария для решения экономических задач; методами и приёмами анализа экономических явлений и процессов с помощью математико-статистических моделей; навыками интерпретации результатов экономического анализа хозяйствующих субъектов
Пороговый	закономерности функционирования современной экономики	строить эконометрические модели и оценивать их параметры	навыками применения математического инструментария для моделирования

			экономических явлений
Стандартный (в дополнение к пороговому)	содержание экономических категорий, механизм их применения в практике	использовать в своей деятельности современные статистические методы и модели прогнозирования социально-экономических явлений и бизнес-процессов	методами статистического анализа взаимосвязи, динамики и тенденций в изменении основных показателей социально-экономических явлений
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	Актуальные вопросы современной экономической науки	производить оценку качества, точности и надежности статистических моделей и прогнозов	Навыками работы в пакетах прикладных программ математико-статистической обработки данных

Профессиональные компетенции (ПК):

ПК-2 - Способен разрабатывать и применять инструментарий выявления и описания статистических закономерностей с помощью методов математической статистики

Планируемые результаты обучения по программе	Планируемые результаты обучения по дисциплине		
	ПК-2.1: Знать:	ПК-2.2: Уметь:	ПК-2.3: Владеть (иметь навыки):
	методы математического анализа и статистики; принципы работы, область применения и принципиальные ограничения методов и инструментов статистического анализа экономических данных; основные закономерности, которым подчиняются массовые случайные явления	применять методы математического и статистического анализа для решения экономических задач; осуществлять мониторинг соответствия инструментов обработки экономических данных поставленным задачам; применять различные подходы к прогнозированию экономических явлений	навыками применения математического инструментария для решения экономических задач; инструментарием анализа и интерпретации данных статистики; навыками работы с нечисловыми данными
Пороговый	основные понятия эконометрики	применять стандартные методы построения эконометрических моделей	навыками обработки реальных статистических данных
Стандартный (в дополнение к пороговому)	методы проверки статистических гипотез о параметрах построенных моделей	проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений	инструментарием анализа и интерпретации реальных статистических данных
Повышенный (в дополнение к пороговому, стандартному)	основные методы диагностики (проверки качества) эконометрических моделей	моделировать бизнес-процессы и использовать их в практической деятельности организаций	навыками работы в статистических и эконометрических пакетах прикладных программ

6.3. Паспорт оценочных материалов

№ п/п	Наименование темы (раздела) дисциплины	Контролируемые планируемые результаты обучения в	Вид контроля/используемые оценочные средства	
			Текущий	Промежуточный

		соотношении с результатами обучения по программе		
1.	Модели временных рядов	ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	Практические задания Тестирование	Экзамен
2.	Программные средства эконометрического моделирования	ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3	Практические задания Тестирование	Экзамен

6.4.Оценочные материалы для текущего контроля

Оценочные материалы для текущего контроля размещены в БРСО ЭИОС СГЭУ в разделе каталога Электронно-оценочные материалы / Магистратура / Экономика/ Аналитика в бизнесе и государственном управлении / 2024 <https://lms2.sseu.ru/course/index.php?categoryid=1923>

Примеры практических заданий

Задание 1

Данные по фирме о размере рекламного бюджета (у.е.):

Кварталы	1	2	3	4	5	6	7
Бюджет, у.е.	17	22	20	19	24	25	29

1. Произвести аналитическое выравнивание ряда по прямой и сделать прогноз на кварталы 8, 9, 10, 11.
2. Проверить наличие автокорреляции по критерию Дарбина - Уотсона при уровне значимости 5% (критические значения $d_1 = 0,70$; $d_2 = 1,36$).
3. Рассчитать абсолютные и относительные показатели качества прогноза, если фактически рекламный бюджет составил в 8 квартале 31 у.е., в 9 квартале 33 у.е., в 10 квартале 30 у.е.
4. Рассчитать оптимальный рекламный бюджет на 11 квартал с помощью МАРЕ-ошибки.

Задание 2

Динамика оптового товарооборота в городе Усмановске (млн. руб.):

Г о д ы	2017	2018	2019	2020	2021
Товарооборот	1209	1278	1380	1470	1565

Сделать прогноз по среднему абсолютному приросту и среднему темпу роста на 2023 год;
Произвести аналитическое выравнивание ряда по прямой и сделать прогноз на 2023 год.

Задание 3

Динамика рождаемости в районе (чел) за ряд лет:

2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
252	258	261	241	270	275	275

- 1) Произвести аналитическое выравнивание ряда по прямой; по параболе.
- 2) Выбрать наиболее адекватную модель тренда и по ней сделать прогноз на 2 года.

Задание 4

Динамика ВВП Испании (млрд. евро):

2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
1116	1079	1081	1070	1040	1026	1037	1076

- ✓ Исследовать структуру временного ряда с помощью АКФ. Построить коррелограмму. Сделать выводы.

Задание 5

Динамика смертности в районе (чел) за ряд лет:

2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
510	520	520	525	524	525	537	555	559

Проверить гипотезу о наличии/отсутствии тренда 5 методами: графическим, критерием восходящих и нисходящих серий, медианы выборки, Фостера-Стюарта, кумулятивным t-критерием.

Задания для тестирования по дисциплине для оценки сформированности компетенций

Что характеризует временной ряд?

- изменение явления во времени
- распределение единиц совокупности по какому-либо признаку
- распределение единиц совокупности по территории страны
- основную тенденцию развития

Среди факторов, оказывающих влияние на уровень временного ряда, можно назвать...:

- автокорреляцию и тренд;
- сезонные колебания и тенденцию;
- динамику и совокупные факторы;
- тенденцию, дисперсию и случайные факторы.

По временному ряду с 1998 по 2007 гг. построена линейная модель тренда $Y_t = 500 + 2 * t$, на основе которой делается прогноз на 2009 год. Прогнозное значение составит:

- 518
- 524
- 4518
- 504

Критерий Дарбина-Уотсона $d=3,9$ (меньше, чем d_1) говорит (2 ответа):

- об отсутствии автокорреляции
- о положительной автокорреляции
- о нахождении в области неопределённости
- об отрицательной автокорреляции
- о наличии автокорреляции

Как называются эконометрические модели, представляющие собой зависимость результативного признака от времени?

- регрессионные модели;
- системы одновременных уравнений;
- трендовые модели;
- модель Кобба-Дугласа

Модель временного ряда считается адекватной, если значения остатков ... (2 ответа):

- меньше табличного (критического) значения
- подчиняются нормальному закону распределения
- являются случайными и независимыми
- положительными

МАРЕ-ошибка равна 5 %. Это означает, что:

- среднее отклонение фактических значений от прогнозных равно 5 %;
- среднее отклонение фактических значений от среднего равно 5 %;
- среднее отклонение фактических значений от прогнозных равно 5 млн.руб.;
- среднее отклонение прогнозных значений от среднего равно 5 кг.

Экспоненциальная модель тренда имеет вид:

- $y_t = a_1 * b^t$
- $y_t = a_0 + a_1 * t + a_2 * t^2$
- $y_t = a_0 + a_1 * t + a_2 * t^2 + a_3 * t^3$
- $y_t = k + a_1 * b^t$

- $y_t = a_0 + a_1 \cdot t$

Уравнение тренда товарооборота магазина (млн. руб.) за 2011-2018 гг. имеет вид:

$$\bar{y}_t = 147 - 5t$$

В чем экономический смысл параметра уравнения тренда 147?

- он не имеет реального экономического смысла
- теоретический объем товарооборота магазина в 2018 г.
- средний ежегодный прирост товарооборота.
- теоретический объем товарооборота магазина в 2011-2018 гг. в целом

Внутреннюю закономерность временного ряда на длительном отрезке времени характеризует:

- сезонная компонента;
- случайная компонента;
- циклическая компонента;
- тренд.

Под экстраполяцией понимают нахождение неизвестных уровней:

- за пределами ряда динамики;
- внутри ряда динамики;
- в середине ряда динамики;
- в прошлом.

Тест Дарбина-Уотсона используется для:

- выявления гетероскедастичности
- определения наличия автокорреляции
- измерения сезонных колебаний
- проверки гипотезы о наличии тренда

Если наиболее высоким оказался коэффициент автокорреляции 4 порядка, то временной ряд имеет:

- линейный тренд
- случайную компоненту
- тренд в виде полинома 4 порядка
- циклические колебания с периодом 4

Последовательность значений коэффициентов автокорреляции называется:

- временным лагом
- автокорреляционной функцией
- колебаниями уровней ряда
- матрицей коэффициентов корреляции

Уравнение $\hat{y}_t = a + b \cdot t + c \cdot t^2$ называется:

- линейным трендом;
- параболическим трендом;
- гиперболическим трендом;
- экспоненциальным трендом.

ARE-ошибка равна 20 кг. Это означает, что:

- среднее отклонение фактических значений от прогнозных равно 20 %.
- среднее отклонение прогнозных значений от среднего равно 20 кг;
- среднее отклонение фактических значений от прогнозных равно 20 млн.руб.;
- среднее отклонение фактических значений от среднего равно 20 кг

Структуру временного ряда можно исследовать на основе ...:

- лаговой переменной
- случайной компоненты
- автокорреляционной функции
- коэффициента детерминации

Графическим представлением автокорреляционной функции является:

- кумулята
- гистограмма
- коррелограмма
- график уравнения тренда

Прогноз сроком 1 - 5 лет называется:

- оперативным;

- краткосрочным;
- среднесрочным;
- долгосрочным

Если период циклических колебаний уровней временного ряда не превышает одного года, то их называют ...

- годовыми;
- конъюнктурными;
- многолетними;
- сезонными.

6.5. Оценочные материалы для промежуточной аттестации

Фонд вопросов для проведения промежуточного контроля в форме экзамена

Раздел дисциплины	Вопросы
Модели временных рядов	<ol style="list-style-type: none"> 1. Моделирование временных рядов: основные понятия 2. Метод Фостера-Стюарта 3. Основные типы уравнения трендов. Линейный тренд, его свойства 4. Основные типы уравнения трендов. Экспоненциальный тренд, его свойства 5. Типы колебаний 6. Автокорреляция в рядах динамики. Статистика Дарбина-Уотсона. 7. Моделирование сезонных колебаний 8. Основные предпосылки систем взаимозависимых переменных. 9. Структурная и приведенная формы модели 10. Рекурсивные системы моделей. 11. Использование классического и двухшагового МНК в оценке параметров рекурсивных моделей 12. Использование косвенного, двухшагового и трехшагового МНК в оценке параметров систем линейных одновременных уравнений 13. Процедура прогноза 14. Доверительный интервал прогноза 15. Коэффициенты автокорреляции. Коррелограмма 16. Показатели качества регрессии 17. АКФ и ЧАКФ 18. AR-модели и MA-модели 19. ARMA-модели 20. ARIMA-модели
Программные средства эконометрического моделирования	<ol style="list-style-type: none"> 21. Эконометрическое моделирование в MS Excel 22. Эконометрическое моделирование в Statistica 23. Эконометрическое моделирование в SPSS 24. Эконометрическое моделирование в Gretl 25. Особенности практического использования пакетов прикладных программ 26. Эконометрическое моделирование в маркетинговых исследованиях 27. Эконометрическое моделирование в стратегических исследованиях 28. Эконометрическое моделирование в социологических исследованиях 29. Эконометрический анализ инфляции 30. Эконометрика прогнозирования и риска 31. Эконометрические методы проведения экспертных исследований и анализа оценок экспертов

6.6. Шкалы и критерии оценивания по формам текущего контроля и промежуточной аттестации

Шкала и критерии оценивания

Оценка	Критерии оценивания для мероприятий контроля с применением 4-х балльной системы
«отлично»	Повышенный ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«хорошо»	Стандартный ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК-2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«удовлетворительно»	Пороговый ОПК-1.1, ОПК-1.2, ОПК-1.3, ОПК-2.1, ОПК-2.2, ОПК- 2.3, ПК-2.1, ПК-2.2, ПК-2.3
«неудовлетворительно»	Результаты обучения не сформированы на пороговом уровне