

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце:

ФИО: Петровская Анна Викторовна

Должность: Директор

Дата подписания: 24.09.2024 11:43:20

Уникальный программный ключ:

798bda6555fbdebe827768f6f1710bd17a9070c31fdc1b6a6ac5a1f10c8c5199

*Приложение 6 к основной профессиональной образовательной программе
по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент
направленность (профиль) программы Менеджмент организации*

МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования
«Российский экономический университет имени Г. В. Плеханова»
Краснодарский филиал РЭУ им. Г. В. Плеханова

Факультет экономики, менеджмента и торговли

Кафедра бухгалтерского учета и анализа

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по учебной дисциплине **Б1.О.10 «ЭКОНОМЕТРИКА И МОДЕЛИРОВАНИЕ В
МЕНЕДЖМЕНТЕ»**

Направление подготовки 38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль) программы Менеджмент организации

Уровень высшего образования Бакалавриат

Год начала подготовки 2022

Краснодар – 2021 г.

Составитель(и):

Старший преподаватель кафедры бухгалтерского учета и анализа А.А.

Маркушина

(ученая степень, ученое звание, должность.)

Оценочные материалы одобрены на заседании кафедры бухгалтерского учета и анализа, протокол №1 от 30.08.2021 г.

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

по учебной дисциплине Эконометрика и моделирование в менеджменте

ПЕРЕЧЕНЬ КОМПЕТЕНЦИЙ С УКАЗАНИЕМ РЕЗУЛЬТАТОВ ОБУЧЕНИЯ И ЭТАПОВ ИХ ФОРМИРОВАНИЯ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Формируемые компетенции (код и наименование компетенции)	Индикаторы достижения компетенций (код и наименование индикатора)	Результаты обучения (знания, умения)	Наименование контролируемых разделов и тем
УК-1 - Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.3 - Выбирает оптимальный вариант решения задачи, аргументируя свой выбор	УК-1.3. 3-1. Знает принципы, критерии, правила построения суждения и оценок	Тема 1. Задачи и методы эконометрики Тема 2. Методы анализа парной линейной регрессии Тема 3. Методы анализа нелинейной парной регрессии Тема 4. Методы анализа множественной линейной регрессии Тема 5. Фиктивные переменные в регрессионном анализе Тема 6 Временные ряды
		УК-1.3. У-2. Умеет применять теоретические знания в решении практических задач	
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	УК-2.2 - Выбирает оптимальные способы решения задач, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.2. 3-1. Знает основные методы принятия решений, в том числе в условиях риска и неопределенности	
		УК-2.2. У-3. Умеет выбирать оптимальные решения исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	
ОПК-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия	ОПК-3.3 - Обосновывает принятие организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	ОПК-3.3. 3-1. Знает методы оценки организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	
		ОПК-3.3. У-1. Умеет оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	

МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИЕ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ

Перечень учебных заданий на аудиторных занятиях

Вопросы для проведения опроса на занятиях

Раздел I. ЗАДАЧИ И МЕТОДЫ ЭКОНОМЕТРИКИ

Тема 1. Задачи и методы эконометрики

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Вопросы для проведения опроса:

1. Поясните термины: эконометрика; эконометрическое моделирование; верификация моделей.
2. Привести классификацию эконометрических моделей.
3. Укажите основные этапы построения эконометрических моделей. Какие типы данных используются в эконометрических исследованиях.
4. По каким типам шкал производятся измерения в эконометрике?
5. Укажите основные методы эконометрики?
6. Поясните порядок сводки и группировки статистических данных.
7. Охарактеризуйте основные типы группировок.
8. Укажите основные виды обобщающих показателей.
9. Укажите виды средних величин и их применение.
10. Перечислите и охарактеризуйте показатели вариации.
11. Сравните различные формы законов распределения, их особенности использования.
12. Укажите свойства и особенности нормального закона распределения.
13. Поясните основные числовые характеристики случайной величины, их размерности и особенности использования.
14. Поясните различия в понятиях: зависимые и независимые величины.
15. Поясните различия в понятиях: коррелированные и некоррелированные случайные величины.
16. Что такое вариационный ряд случайной величины?
17. Поясните различие и особенности точечных и интервальных оценок статистических показателей.
18. Укажите виды статистических оценок параметров и их свойства.
19. Поясните смысл интервальных оценок экономических показателей.
20. Перечислите компьютерные программы в практике эконометрических исследований и дайте им краткую характеристику.

Критерии оценки (в баллах):

- 1 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 0,5 балл выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме, при ответе допущены неточности;

- 0,2 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен не в полном объеме, при ответе допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос не представлен, или при ответе допущены грубые ошибки.

Раздел II. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ

Тема 2. Методы анализа парной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Вопросы для проведения опроса:

1. Опишите модель парной линейной регрессии.
2. С помощью какого метода можно найти параметры уравнения линейной парной регрессии?
3. Опишите метод наименьших квадратов.
4. Сформулируйте теорему Гаусса-Маркова.
5. Коэффициенты корреляции и детерминации и их экономический смысл.
6. Показатели качества регрессии.
7. Проверка качества регрессии.
8. F-критерий Фишера.
9. t-критерий Стьюдента.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме, при ответе допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен не в полном объеме, при ответе допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос не представлен, или при ответе допущены грубые ошибки.

Тема 3. Методы анализа нелинейной парной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Вопросы для проведения опроса:

1. Нелинейная парная регрессия – определение.
2. Способы линеаризации.
3. Оценивание моделей, не поддающихся линеаризации.
4. Индексы корреляции и детерминации.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме, при ответе допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен не в полном объеме, при ответе допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос не представлен, или при ответе допущены грубые ошибки.

Тема 4. Методы анализа множественной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Вопросы для проведения опроса:

1. Спецификация и предпосылки классической линейной модели множественной регрессии (КЛММР).
2. Перечислить статистические свойства оценок коэффициентов.
3. Поясните, что показывает дисперсия и доверительный интервал при оценке коэффициентов регрессии.
4. В чем отличие выборочного парного и множественного коэффициентов корреляции.
5. Множественные коэффициенты детерминации различных порядков.
6. Дать определение нецентрированному выборочному коэффициенту детерминации, пояснить его экономический смысл.
7. Статистические характеристики и различные типы остатков в КЛММР.
8. Графические и статистические методы анализа остатков.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме, при ответе допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен не в полном объеме, при ответе допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос не представлен, или при ответе допущены грубые ошибки.

Тема 5. Фиктивные переменные в регрессионном анализе

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Вопросы для проведения опроса:

1. Сформулируйте определение фиктивной переменной.
2. Приведите пример применения фиктивных переменных при составлении и анализе регрессионных моделей.

Критерии оценки (в баллах):

- 1 балл выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме, при ответе допущены неточности;
- 0,2 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен не в полном объеме, при ответе допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос не представлен, или при ответе допущены грубые ошибки.

Раздел III. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ

Тема 6. Временные ряды

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Вопросы для проведения опроса:

1. Что такое временной ряд?
2. Назовите модели временных рядов.
3. Что называется лагом?
4. Что такое автокорреляция уровней временного ряда?
5. Что свидетельствует о наличии тенденции временного ряда?
6. Что свидетельствует о наличии сезонных или циклических колебаний временного ряда?

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен в полном объеме, при ответе допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос представлен не в полном объеме, при ответе допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если ответ на вопрос не представлен, или при ответе допущены грубые ошибки.

Задания для текущего контроля

Расчетно-аналитические задания

Раздел I. ЗАДАЧИ И МЕТОДЫ ЭКОНОМЕТРИКИ

Тема 1. Задачи и методы эконометрики

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Задание 1. Доходы трех банков от кредитов в отчетном периоде характеризуются следующими показателями:

№ банка	Средняя процентная ставка	Доход банка, тыс. руб.
1	20	600
2	25	350
3	21	480
ИТОГО		1480

Определите среднюю процентную ставку банков.

Задание 2. С какой вероятностью можно утверждать, что возможность покупки изделия с дефектом находится в пределах от 8 до 12 процентов, если из 30 обследованных изделий, купленных в этом магазине, три оказались с дефектом?

Задание 3. Сколько надо произвести опытов, чтобы с вероятностью 0,95 получить коэффициент корреляции двух экономических показателей с точностью 0,3?

Задание 4. По имеющимся данным построить закон распределения заданной случайной величины:

Количество сделок (договоров) фирмы по месяцам (ед.): 18, 22, 23, 24, 25, 24, 27, 25, 23, 22, 23, 27, 26, 24, 22, 20, 21, 22, 23, 22, 23, 22, 21, 20, 19, 16, 17, 20, 22, 22, 23, 27, 30, 28, 27, 25, 27, 25, 22, 20, 20, 21, 23, 27, 29, 33, 30, 39, 26, 24, 32, 21, 18, 20, 22, 23, 24, 26.

Необходимо:

- 1) Построить вариационный ряд исследуемой случайной величины;
- 2) Произвести группировку данных вариационного ряда на 6-10 интервалов (разрядов, групп);
- 3) Вычислить и представить графически эмпирическую функцию распределения исследуемой случайной величины;
- 4) Выровнять (аппроксимировать) имеющиеся данные подходящим теоретическим законом распределения заданной случайной величины;
- 5) Проанализировать полученные результаты.

Критерии оценки (в баллах):

- 1 балл выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 0,2 балла выставляется обучающемуся, если задание решено не в полном объеме, при решении допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если задание не решено, или при решении допущены грубые ошибки.

Раздел II. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ

Тема 2. Методы анализа парной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Задание 1. Экономист, изучая зависимость y (тыс. ден. ед.) издержек обращения от объема x (тыс. ден. ед.) товарооборота, обследовал 10 магазинов, торгующих одинаковым ассортиментом товаров. Полученные данные отражены в таблице:

x	160	120	110	80	90	70	150	60	140	110
y	12,5	9,3	9,2	6,4	7,5	11,6	13,1	5,2	7,9	4,4

- 1) Найти коэффициент корреляции зависимости между величинами x и y . Построить корреляционное поле.
- 2) Построить регрессионную функцию линейной зависимости фактора y от фактора x и исследовать ее на надежность по критерию Фишера при уровне значимости 0,05.
- 3) Найти коэффициент эластичности.
- 4) Определить надежность коэффициентов регрессии по критерию Стьюдента.
- 5) Найти доверительные интервалы для коэффициентов регрессии.
- 6) Построить график регрессионной функции и диаграмму рассеяния.
- 7) Исследуя полученное уравнение регрессии, оценить с помощью доверительного интервала ожидаемое значение признака y для выбранного Вами будущего значения x тыс. ден. ед.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если задание решено не в полном объеме, при решении допущены незначительные ошибки;

- 0 баллов выставляется обучающемуся, если задание не решено, или при решении допущены грубые ошибки.

Тема 3. Методы анализа нелинейной парной регрессии

Индикаторы достижения: ОПК-1.3, ОПК-2.2, ОПК-3.3.

Задание 1.

По семи территориям Уральского района за 199X г. известны значения двух признаков (табл. 1.1).

Таблица 1.1

Район	Расходы на покупку продовольственных товаров в общих расходах, %, y	Среднедневная заработная плата одного работающего, руб., x
Удмуртская респ.	68,8	45,1
Свердловская обл.	61,2	59,0
Башкортостан	59,9	57,2
Челябинская обл.	56,7	61,8
Пермская обл.	55,0	58,8
Курганская обл.	54,3	47,2
Оренбургская обл.	49,3	55,2

Требуется:

1. Для характеристики зависимости y от x рассчитать параметры следующих функций:

- а) линейной;
- б) степенной;
- в) показательной;
- г) равнобочной гиперболы.

2. Оценить каждую модель через среднюю ошибку аппроксимации \bar{A} и F -критерий Фишера.

Задание 2.

По группе предприятий, производящих однородную продукцию, известно, как зависит себестоимость единицы продукции y от факторов, приведенных в табл. 1.8.

Таблица 1.8

Признак-фактор	Уравнение парной регрессии	Среднее значение фактора
Объем производства, млн руб., x_1	$\hat{y}_{x_1} = 0,62 + 58,74 \cdot \frac{1}{x_1}$	$\bar{x}_1 = 2,64$
Трудоемкость единицы продукции, чел.-час, x_2	$\hat{y}_{x_2} = 9,30 + 9,83 \cdot x_2$	$\bar{x}_2 = 1,38$
Оптовая цена за 1 т энергоносителя, млн руб., x_3	$\hat{y}_{x_3} = 11,75 + x_3^{1,6281}$	$\bar{x}_3 = 1,503$
Доля прибыли, изымаемой государством, %, x_4	$\hat{y}_{x_4} = 14,87 \cdot 1,016^{x_4}$	$\bar{x}_4 = 26,3$

Требуется:

1. Определить с помощью коэффициентов эластичности силу влияния каждого фактора на результат.
2. Ранжировать факторы по силе влияния.

Критерии оценки (в баллах):

- 1 балл выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 0,2 балла выставляется обучающемуся, если задание решено не в полном объеме, при решении допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если задание не решено, или при решении допущены грубые ошибки.

Тема 4. Методы анализа множественной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Задание 1. Для изучения рынка жилья в городе по данным о 46 коттеджах было построено уравнение множественной регрессии:

$$y = 21,1 - 6,2 x_1 + 0,95 x_2 + 3,57 x_3; R^2 = 0,7,$$

$$(1,8) \quad (0,54) \quad (0,83),$$

где y - цена объекта, тыс. долл.; x_1 - расстояние до центра города, км; x_2 - полезная площадь объекта, кв. м; x_3 - число этажей в доме, ед.

(В скобках указаны значения стандартных ошибок для коэффициентов множественной регрессии.) Требуется оценить значимость каждого из коэффициентов регрессии. Выделить наиболее и наименее значимые коэффициенты.

Задание 2. По 20 предприятиям легкой промышленности получена следующая информация, характеризующая зависимость объема выпуска продукции y (млн. руб.) от количества отработанных за год человеко-часов x_1 (тыс. чел.-ч.) и среднегодовой стоимости производственного оборудования x_2 (млн. руб.):

Уравнение регрессии	$y = 35 + 0,06 x_1 + 2,5 x_2$
Множественный коэффициент корреляции	0,9
Сумма квадратов отклонений расчетных значений результата от фактических	3000

Определите коэффициент детерминации в этой модели.

Задание 3. Анализируется зависимость объема производства продукции предприятиями отрасли черной металлургии от затрат труда и расхода чугуна. Для этого по 20 предприятиям собраны следующие данные: y - объем продукции предприятия в среднем за год (млн. руб.), x_1 - среднегодовая списочная численность рабочих (чел.), x_2 - средние затраты чугуна за год (млн. т). В таблице представлены результаты корреляционного анализа этого массива данных.

	y	X_1	X_2
y	1		
X_1	0,78	1	
X_2	0,86	0,96	1

Требуется пояснить смысл приведенных выше коэффициентов. Оценить возможность построения множественной регрессии.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если задание решено не в полном объеме, при решении допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если задание не решено, или при решении допущены грубые ошибки.

Тема 5. Фиктивные переменные в регрессионном анализе

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Задание 1. Исследовать зависимость цены (Y) квартиры от ее площади (X) и типа дома (блочный, кирпичный).

№ п.п.	Y	X	тип
1	36849	36,38	блочн.
2	37214	37,03	блочн.
3	49379	37,87	кирпичн.
4	50519	38,63	кирпичн.
5	42125	41,74	блочн.
6	42128	42,08	блочн.
7	56149	43,11	кирпичн.
8	56578	43,81	кирпичн.
9	45138	45,1	блочн.
10	60231	46,45	кирпичн.
11	62108	47,91	кирпичн.
12	48809	48,68	блочн.
13	66018	51,03	кирпичн.
14	51549	51,45	блочн.
15	52779	52,89	блочн.
16	73355	56,3	кирпичн.
17	73066	56,43	кирпичн.
18	56219	56,5	блочн.
19	58848	59,25	блочн.
20	60877	61,01	блочн.
21	78899	61,05	кирпичн.
22	61965	61,53	блочн.
23	80560	61,7	кирпичн.
24	84954	65,5	кирпичн.
25	86024	66,02	кирпичн.
26	67902	68,05	блочн.
27	89847	69,04	кирпичн.
28	70000	69,87	блочн.
29	70386	70,87	блочн.
30	72814	72,36	блочн.
31	95646	73,47	кирпичн.
32	97153	74,67	кирпичн.
33	77009	76,95	блочн.
34	101581	78,37	кирпичн.
35	78977	79,06	блочн.
36	102706	79,24	кирпичн.
37	80311	80,06	блочн.
38	82574	82,19	блочн.
39	108070	83,46	кирпичн.
40	109673	84,42	кирпичн.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если задание решено не в полном объеме, при решении допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если задание не решено, или при решении допущены грубые ошибки.

Раздел III. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ

Тема 6. Временные ряды

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Задание 1. По данным о средних доходах на конечное потребление за десять лет, которые представлены в табл. 1, оцените наличие тренда и в случае положительного ответа постройте трендовую модель.

Расходы на конечное потребление, тыс. у.е.

Год (t)	Расходы (y_t)
1-й	7
2-й	8
3-й	8
4-й	10
5-й	11
6-й	12
7-й	14
8-й	16
9-й	17
10-й	19

Задание 2 Провести сглаживание данных задачи 1 и выполнить прогноз на период $t=11$.

Критерии оценки (в баллах):

- 2 балла выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме без ошибок и недочетов;
- 1 балл выставляется обучающемуся, если задание решено в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 0,5 балла выставляется обучающемуся, если задание решено не в полном объеме, при решении допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если задание не решено, или при решении допущены грубые ошибки.

Комплекты заданий для контрольных работ

Тема 2. Методы анализа парной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

№1. Для уравнения линейной парной регрессии при пятнадцати наблюдениях известны следующие значения $\sum x = 15$, $\sum x^2 = 85$, $\sum xy = 125$, $\sum y = 58$, $\sum y^2 = 120$. Найдите уравнение линейной регрессии.

№2. Рассчитайте коэффициент детерминации для парной прямолинейной зависимости при двенадцати узловых точках, если известно, что $\sum x = 15$, $\sum x^2 = 85$, $\sum xy = 95$, $\sum y = 58$, $\sum y^2 = 320$, остаточная дисперсия результативного признака равна 7,6, а общая дисперсия 15,2. Сделайте вывод относительно полученного результата.

№3. Руководство торгового предприятия изучает статистические данные об объемах продаж товаров (П1, П2, ..., шт.) в зависимости от их цены (Ц1, Ц2, ..., тыс. руб.).

Цена товара					Объем продаж				
Ц ₁	Ц ₂	Ц ₃	Ц ₄	Ц ₅	П ₁	П ₂	П ₃	П ₄	П ₅
9,23	11,68	13,83	18,24	20,76	165	85	72	39	9

Требуется выполнить следующие действия.

- 1) Представить полученные данные на координатной плоскости в виде поля корреляции.
- 2) Вычислить средние значения и дисперсии для каждого из признаков и коэффициент корреляции между ними и сделать вывод.
- 3) Вычислить коэффициенты линейной парной регрессии, представляющей зависимость объема продаж от цены.
- 4) Построить график регрессии на поле корреляции. Отложить на координатной плоскости средние значения.
- 5) Вычислить среднюю относительную ошибку аппроксимации и сделать вывод.
- 6) Вычислить коэффициент детерминации и сделать вывод.
- 7) Вычислить средний коэффициент эластичности спроса по цене и сделать вывод.
- 8) С использованием F-критерия Фишера провести анализ статистической значимости уравнения регрессии при уровнях значимости 1% и 5 %.
- 9) Дать точечный прогноз объема продаж по цене, сниженной на 5 % от максимальной цены.
- 10) Сопоставить доход, который даёт продажа по максимальной цене, и прогноз дохода при продаже по сниженной цене. Сделать вывод о целесообразности снижения цены.
- 11) Дать интервальный прогноз объема продаж по цене, составляющей 90 % от минимальной цены, с доверительной вероятностью 0,90.
- 12) Для одного из трёх видов нелинейной регрессии – гиперболической, степенной, показательной – вычислить коэффициенты уравнения и построить линию регрессии на поле корреляции.

Критерии оценки (в баллах):

- 20 баллов выставляется обучающемуся, если контрольная решена в полном объеме без ошибок и недочетов (номер 1 оценивается в 4 балла, номер 2 – в 4 балла, пункты номера 3 оцениваются в 1 балл каждый);
- 15 баллов выставляется обучающемуся, если контрольная решена в полном объеме, при решении допущены неточности;
- 10 баллов выставляется обучающемуся, если контрольная решена не в полном объеме (50% работы выполнено), при решении допущены незначительные ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если контрольная не решена, или при решении допущены грубые ошибки.

Задания для творческого рейтинга

Темы для докладов

Раздел I. ЗАДАЧИ И МЕТОДЫ ЭКОНОМЕТРИКИ

Тема 1. Задачи и методы эконометрики

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Темы презентаций, рефератов, докладов:

1. История зарождения эконометрики как науки. Основоположники.
2. Этапы эконометрического исследования.
3. Типы данных в эконометрических моделях. Примеры.

Раздел II. РЕГРЕССИОННЫЙ АНАЛИЗ

Тема 2. Методы анализа парной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Темы презентаций, рефератов, докладов:

1. Классические линейные регрессионные модели и основные этапы их анализа в эконометрике.
2. Оценивание параметров линейных регрессионных моделей по методу наименьших квадратов и свойства оценок в классических моделях.
3. Оценивание параметров линейных регрессионных моделей по методу максимального правдоподобия.
4. Статистические свойства оценок параметров классических линейных моделей по методу наименьших квадратов.
5. Проверка гипотез и определение доверительных интервалов параметров линейных классических моделей.

Тема 3. Методы анализа нелинейной парной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Темы презентаций, рефератов, докладов:

1. Модели нелинейной регрессии, нелинейные по параметрам.
2. Модели нелинейной регрессии, нелинейные по переменным.

Тема 4. Методы анализа множественной линейной регрессии

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Темы презентаций, рефератов, докладов:

1. Особенности обобщенной линейной модели множественной регрессии (ОЛММР).
2. Обобщенный метод наименьших квадратов (ОМНК).
3. Теорема Айткена.
4. Оценка параметров преобразованной модели регрессии.
5. Тесты ранговой корреляции Спирмена, Голдфелда – Квандта, Глейзера.

Тема 5. Фиктивные переменные в регрессионном анализе

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Темы презентаций, рефератов, докладов:

1. Фиктивные переменные в регрессионном анализе.

Раздел III. ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ

Тема 6. Временные ряды

Индикаторы достижения: УК-1.3, УК-2.2, ОПК-3.3.

Темы презентаций, рефератов, докладов:

1. Понятие и характеристики временных рядов. Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры.
2. Модели стационарных временных рядов и их идентификация. Модели нестационарных временных рядов.
3. Прогнозирование, основанное на использовании моделей временных рядов.
4. Специфика изучения взаимосвязей по временным рядам. Исключение тенденции. Исключение сезонных колебаний.
5. Моделирование сезонных и циклических колебаний. Моделирование тенденции временного ряда (построение тренда).

Критерии оценки (в баллах):

- 10 баллов выставляется обучающемуся, если тема доклада раскрыта, приведены верные примеры, студент свободно ориентируется в теме доклада, отвечает на дополнительные вопросы;
- 7 баллов выставляется обучающемуся, если тема доклада раскрыта, приведены верные примеры, студент при ответе на дополнительные вопросы допускает неточности;
- 5 баллов выставляется обучающемуся, если тема доклада раскрыта, приведенные примеры не соответствуют теме, студент, отвечая на дополнительные вопросы, допускает ошибки;
- 0 баллов выставляется обучающемуся, если тема доклада не раскрыта, или при ответе на вопросы допущены грубые ошибки.

МЕТОДИЧЕСКИЕ МАТЕРИАЛЫ, ХАРАКТЕРИЗУЮЩИЕ ЭТАПЫ ФОРМИРОВАНИЯ КОМПЕТЕНЦИЙ ВО ВРЕМЯ ПРОВЕДЕНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

Структура экзаменационного билета

<i>Наименование оценочного средства</i>	<i>Максимальное количество баллов</i>
<i>Вопрос 1</i>	<i>10</i>
<i>Вопрос 2</i>	<i>10</i>
<i>Практическое задание (расчетно-аналитическое)</i>	<i>10</i>
<i>Практическое задание (расчетно-аналитическое)</i>	<i>10</i>

Задания, включаемые в экзаменационный билет

Типовой перечень вопросов к экзамену:

Номер вопроса	Перечень вопросов к экзамену
1	Понятие эконометрики. Связь эконометрики с другими областями знаний.
2	Эконометрическая модель – главный инструмент эконометрических исследований. Задачи, решаемые на её основе.
3	Этапы эконометрического исследования.
4	Типы данных и виды переменных в эконометрических исследованиях.
5	Классификация эконометрических методов.
6	Компьютерные программы в практике эконометрических исследований. Сравнительный анализ компьютерных программ. Выбор программ для практической работы
7	Двумерная (однофакторная) регрессионная модель.
8	Нормальная линейная регрессионная модель с одной переменной.
9	Традиционный метод наименьших квадратов – МНК (OLS).
10	Оценка дисперсии случайной составляющей. Статистические свойства МНК-оценок: состоятельность, несмещенность, эффективность.
11	Теорема Гаусса-Маркова.
12	Показатели качества регрессии.

13	Проверка качества регрессии. F-критерий Фишера.
14	Проверка гипотез о значимости параметров регрессии, коэффициента корреляции и уравнения регрессии в целом. t-критерий Стьюдента.
15	Прогноз ожидаемого значения результативного признака по линейному парному уравнению регрессии.
16	Интервальная оценка функции регрессии и ее параметров.
17	Нелинейная регрессия. Виды нелинейной регрессии.
18	Нелинейные модели регрессии и их линеаризация.
19	Нелинейные модели относительно включенных в анализ объясняющих переменных.
20	Регрессионные модели, нелинейные по оцениваемым параметрам.
21	Коэффициент эластичности.
22	Индекс корреляции. Индекс детерминации
23	Нормальная линейная модель множественной регрессии.
24	Линейные регрессионные модели с гетероскедастичными и автокоррелированными остатками.
25	Мультиколлинеарность факторных переменных. Причины, методы измерения и устранения мультиколлинеарности.
26	Отбор факторов, включаемых в модель множественной регрессии.
27	Традиционный метод наименьших квадратов для многомерной регрессии (OLS)
28	Обобщенный метод наименьших квадратов. (ОМНК) для множественной регрессии.
29	Показатели тесноты связи фактора с результатом: коэффициенты частной эластичности.
30	Показатели тесноты связи фактора с результатом: стандартизованные коэффициенты регрессии.
31	Частная корреляция.
32	Коэффициенты множественной детерминации и корреляции.
33	Скорректированный коэффициент множественной детерминации.
34	Оценка значимости уравнения множественной регрессии.
35	Оценка значимости фактора, дополнительно включенного в модель регрессии. Частный F-критерий Фишера.
36	Фиктивные переменные множественной регрессии. Модели с фиктивными переменными.
37	Тест Чоу.
37	Нелинейная множественная регрессия.
38	Гетероскедастичность случайной составляющей. Графический анализ остатков на обнаружение гетероскедастичности.
39	Тест ранговой корреляции Спирмена.
40	Тест Парка.
41	Тест Глейзера.
42	Тест Голдфелда-Квандта.
43	Метод взвешенных наименьших квадратов.
44	Автокорреляция случайных составляющих. Обнаружение автокорреляции случайных составляющих.
45	Графический метод обнаружения автокорреляции.
46	Метод рядов обнаружения автокорреляции.
47	Критерий Дарбина – Уотсона.
48	Устранение автокорреляции случайных составляющих.

49	Стохастические объясняющие переменные.
50	Обнаружение корреляции объясняющих переменных и случайной составляющей.
51	Понятие и характеристики временных рядов.
52	Модели стационарных временных рядов и их идентификация.
53	Модели нестационарных временных рядов.
54	Прогнозирование, основанное на использовании моделей временных рядов.
55	Автокорреляция уровней временного ряда и выявление его структуры.
56	Моделирование тенденции временного ряда (построение тренда).
57	Моделирование сезонных и циклических колебаний.
58	Специфика изучения взаимосвязей по временным рядам. Исключение сезонных колебаний.
59	Специфика изучения взаимосвязей по временным рядам. Исключение тенденции.
60	Модели с распределённым лагом. Интерпретация параметров.
61	Средний и медианный лаги. Изучение структуры лагов
62	Оценивание параметров моделей с распределённым лагом. Метод Алмон.
63	Оценивание параметров моделей с геометрической структурой лага. Метод Койка.
64	Авторегрессионные динамические модели.

Расчетно-аналитические задания/задачи к экзамену:

Тема 1. Задачи и методы эконометрики

Задача 1. По 30 различным предприятиям края собраны статистические данные за прошедший год о доле прибыли, направленной для выплаты дивидендов по своим акциям, и объеме средств (млн. руб.), выделенных на развитие производства.

№ предприятия	Прибыль для выплаты дивидендов по акциям, %	Объем средств, направленных на развитие производства, млн. руб.
1	11,9	17,6
2	16,3	11,4
3	9,1	33,4
4	11,4	29,6
5	13,4	15,5
6	21,7	10,0
7	18,3	19,3
8	15,5	6,0
9	16,8	28,3
10	12,0	21,5
11	19,3	11,7
12	13,6	23,5
13	15,0	17,7
14	14,0	27,0
15	17,1	14,9
16	8,7	25,5
17	16,6	17,4
18	15,3	24,6
19	16,2	20,4
20	18,6	27,4
21	15,7	12,0

№ предприятия	Прибыль для выплаты дивидендов по акциям, %	Объем средств, направленных на развитие производства, млн. руб.
22	14,4	29,6
23	16,0	36,0
24	18,2	13,1
25	17,2	31,8
26	10,8	35,5
27	18,0	10,7
28	11,5	12,3
29	9,7	11,7
30	20,4	10,6

Необходимо:

1. Получить интервальный ряд, характеризующий распределение предприятий по сумме средств, направленных на развитие производства, образцов пять групп с равными интервалами;
2. Построить корреляционную таблицу и аналитическую группировку для изучения связи между процентом прибыли для выплаты дивидендов по акциям и объемом средств, направленных на развитие производства.

Тема 2. Методы анализа парной линейной регрессии

Задача 1. По территориям региона приводятся данные за 2014 г.

Требуется:

3. Построить линейное уравнение парной регрессии y от x .
4. Рассчитать линейный коэффициент парной корреляции и среднюю ошибку аппроксимации.
5. Оценить статистическую значимость параметров регрессии и корреляции с помощью F -критерия Фишера.
6. На одном графике построить исходные данные и теоретическую прямую.

Номер региона	Среднедушевой прожиточный минимум в день одного трудоспособного, руб., x	Среднедневная заработная плата, руб., y
1	81	124
2	77	131
3	85	146
4	79	139
5	93	143
6	100	159
7	72	135
8	90	152
9	71	127
10	89	154
11	82	127
12	111	162

Тема 3. Методы анализа нелинейной парной регрессии

Задача 1. По группе предприятий, производящих однородную продукцию, известно, как зависит себестоимость единицы продукции y от факторов, приведенных в таблице. Определите с помощью коэффициентов эластичности силу влияния каждого фактора на результат.

Проранжируйте факторы по силе влияния, сделайте вывод.

Признак-фактор	Уравнение парной регрессии	Среднее значение признака
Трудоемкость единицы производства, чел.-час., x_1	$Y_{x_1} = 9,3 + 9,83x_1$	1,38
Объем производства, млн.ден.ед., x_2	$Y_{x_2} = 0,62 + \frac{58,47}{x_2}$	2,64
Цена за одну тонну энергоносителя, млн.ден.ед., x_3	$Y_{x_3} = 11,73x_3^{1,6281}$	1,503
Доля прибыли, изымаемой государством, %, x_4	$Y_{x_4} = 14,87 \cdot 1,016^{x_4}$	26,3

Тема 4. Методы анализа множественной линейной регрессии

Составить план и модель решения средствами табличного процессора MS Excel для следующих задач:

Задача 1. При изучении зависимости $y = f(x_1, x_2, x_3)$ матрица парных коэффициентов корреляции оказалась следующей:

	y	x_1	x_2	x_3
y	1	0,8	0,7	0,6
x_1	0,8	1	0,8	0,5
x_2	0,7	0,8	1	0,2
x_3	0,6	0,5	0,2	1

Определить какие факторы необходимо включить в уравнение множественной регрессии.

Задача 2. Пусть имеются следующие данные (условные) о сменной добыче угля на одного рабочего y (т), мощности пласта x_1 (м) и уровне механизации работ x_2 (%), характеризующие процесс добычи угля в 10 шахтах.

№	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10
x_1	8	11	12	9	8	8	9	9	8	12
x_2	5	8	8	5	7	8	6	4	5	7
y	5	10	10	7	5	6	6	5	6	8

Предполагая, что между переменными y , x_1 , x_2 существует линейная корреляционная зависимость, найдите уравнение регрессии y по x_1 и x_2 .

Тема 5. Фиктивные переменные в регрессионном анализе

Задача 1. По данным о величине совокупного объема инвестиций Y и ВВП США X за период с 1939 по 1954 г. оцените насколько сказались военные действия в Европе в период 1942—1945 гг. на объеме внутренних инвестиций. Изменился ли характер зависимости объемов внутренних инвестиций от ВВП в годы войны?

Годы	1939	1940	1941	1942	1943	1944	1945	1946
Y	9,3	13,1	17,9	9,9	5,8	7,2	10,6	30,7
X	90,8	100,0	124,9	158,3	192,0	210,5	212,3	209,3
Годы	1947	1948	1949	1950	1951	1952	1953	1954
Y	34,0	45,9	35,3	53,8	59,2	52,1	53,3	52,7
X	232,8	259,1	258,0	286,2	330,2	347,2	366,1	366,3

Тема 6. Временные ряды

Задача 1. Имеются следующие данные о среднем размере товарных запасов в универмаге по месяцам года, млн. руб.:

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
21,2	21,3	21,2	21,3	21,2	21,0	21,0	20,2	19,2	20,1	20,8	21,1

Произведите сглаживание ряда товарных запасов универмага методом скользящей средней с шириной окна $m=4$. Сделайте выводы о характере общей тенденции изучаемого явления.

Задача 2. Уровень временного ряда (y_t) описывается мультипликативной моделью. Установлено, что периодичность временного ряда составляет $\tau=4$, получены значения сезонных компонент: $S_1 = 2,087$; $S_2 = 0,632$; $S_3 = 0,931$; $S_4 = 3,256$. Модель тренда получена в виде $T=3,14+2,07*t$. Рассчитать модельное значение временного ряда для 6-го показателя $t=6$ или $y(6)$.

Задача 3. Уровень временного ряда (y_t) описывается аддитивной моделью. Установлено, что периодичность временного ряда составляет $\tau=3$, получены значения сезонных компонент: $S_1 = 1,7$; $S_2 = -0,9$; $S_3 = 0,1$. Модель тренда получена в виде $T=0,3+1,8*t$. Рассчитать модельное значение временного ряда для 4-го показателя $t=4$ или $y(4)$.

Тематика курсовых работ/проектов (при наличии):

Курсовая работа по дисциплине «Эконометрика и моделирование в менеджменте» учебным планом не предусмотрена.

Показатели и критерии оценивания планируемых результатов освоения компетенций и результатов обучения, шкала оценивания

Шкала оценивания		Формируемые компетенции	Индикатор достижения компетенции	Критерии оценивания	Уровень освоения компетенций
85 – 100 баллов	«отлично»	УК-1 - Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения	УК-1.3 - Выбирает оптимальный вариант решения задачи, аргументируя свой выбор	Знает верно и в полном объеме: принципы, критерии, правила построения суждения и оценок Умеет верно и в полном объеме: применять теоретические	Продвинутый

		поставленных задач		знания в решении практических задач	
		УК-2 - Способен определять крупные задачи в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.2 - Выбирает оптимальные способы решения задач, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	Знает верно и в полном объеме: основные методы принятия решений, в том числе в условиях риска и неопределенности Умеет верно и в полном объеме: выбирать оптимальные способы решения исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	
		ОПК-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия	ОПК-3.3 Обосновывает принятие организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	Знает верно и в полном объеме: методы оценки организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды Умеет верно и в полном объеме: оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	

		ОПК-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия	ОПК-3.3 - Обосновывает принятие организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	Знает с незначительными замечаниями: методы оценки организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды Умеет с незначительными замечаниями: оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	
50 – 69 баллов	«удовлетворительно»	УК-1 - Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.3 - Выбирает оптимальный вариант решения задачи, аргументируя свой выбор	Знает на базовом уровне, с ошибками: принципы, критерии, правила построения суждения и оценок Умеет на базовом уровне, с ошибками: применять теоретические знания в решении практических задач	Базовый
		УК-2 - Способен определять крупные задачи в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.2 - Выбирает оптимальные способы решения задач, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	Знает на базовом уровне, с ошибками: основные методы принятия решений, в том числе в условиях риска и неопределенности Умеет на базовом уровне, с ошибками: выбирать оптимальные способы решения исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	

		ОПК-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия	ОПК-3.3 Обосновывает принятие организационно-управленческих решений в условиях сложной динамичной среды	-Знает на базовом уровне, с ошибками: методы оценки организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды Умеет на базовом уровне, с ошибками: оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды	
менее 50 баллов	«неудовлетворительно»	УК-1 - Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.3 - Выбирает оптимальный вариант решения задачи, аргументируя свой выбор	Не знает на базовом уровне: принципы, критерии, правила построения суждения и оценок Не умеет на базовом уровне: применять теоретические знания в решении практических задач	Компетенции не сформированы
		УК-2 - Способен определять крупные задачи в рамках поставленной цели и выбирать оптимальные способы их решения, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	УК-2.2 - Выбирает оптимальные способы решения задач, исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	Не знает на базовом уровне: основные методы принятия решений, в том числе в условиях риска и неопределенности Не умеет на базовом уровне: выбирать оптимальные способы решения исходя из действующих правовых норм, имеющихся ресурсов и ограничений	
		ОПК-3 - Способен разрабатывать обоснованные организационно-	ОПК-3.3 Обосновывает принятие организационно-	-Не знает на базовом уровне: методы оценки организационно-	

		<p>управленческие решения с учетом их социальной значимости, содействовать их реализации в условиях сложной и динамичной среды и оценивать их последствия</p>	<p>управленческих решений в условиях сложной динамичной среды</p>	<p>управленческих решений в условиях сложной динамичной среды</p> <p>Не умеет на базовом уровне: оценивать результативность принятия организационно-управленческих решений в условиях сложной и динамичной среды</p>	
--	--	---	---	---	--