МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования

«ТОМСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ СИСТЕМ
УПРАВЛЕНИЯ И РАДИОЭЛЕКТРОНИКИ»
(ТУСУР)

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по учебной работе
_____ П. В. Сенченко
«___» _____ 20__ г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Макростатистический анализ и прогнозирование

Уровень образования: **высшее образование - специалитет**
Направление подготовки / специальность: **38.05.01 Экономическая безопасность**
Направленность (профиль) / специализация: **Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности**
Форма обучения: **заочная**
Факультет: **ЗиВФ, Заочный и вечерний факультет**
Кафедра: **КИБЭВС, Кафедра комплексной информационной безопасности электронно-вычислительных систем**
Курс: **4, 5**
Семестр: **7, 8, 9**
Учебный план набора 2020 года

Распределение рабочего времени

№	Виды учебной деятельности	7 семестр	8 семестр	9 семестр	Всего	Единицы
1	Лекции	4	2	0	6	часов
2	Практические занятия	4	6	0	10	часов
3	Контроль самостоятельной работы (курсовой проект / курсовая работа)	0	0	4	4	часов
4	Всего аудиторных занятий	8	8	4	20	часов
5	Самостоятельная работа	64	91	32	187	часов
6	Всего (без экзамена)	72	99	36	207	часов
7	Подготовка и сдача экзамена	0	9	0	9	часов
8	Общая трудоемкость	72	108	36	216	часов
					6.0	З.Е.

Контрольные работы: 8 семестр - 1
Экзамен: 8 семестр
Курсовой проект / курсовая работа: 9 семестр

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Сенченко П.В.
Должность: Проректор по УР
Дата подписания: 18.12.2019
Уникальный программный ключ:
a1119608-cdff-4455-b54e-5235117c185c

Томск

Согласована на портале № 51644

Рассмотрена и одобрена на заседании кафедры
протокол № 12 от «26» 11 2019 г.

ЛИСТ СОГЛАСОВАНИЯ

Рабочая программа дисциплины составлена с учетом требований федерального государственного образовательного стандарта высшего образования (ФГОС ВО) по направлению подготовки (специальности) 38.05.01 Экономическая безопасность, утвержденного 16.01.2017 года, рассмотрена и одобрена на заседании кафедры КИБЭВС «___» _____ 20__ года, протокол №_____.

Разработчик:

старший преподаватель кафедра комплексной информационной безопасности электронно-вычислительных систем (КИБЭВС) _____ Е. С. Катаева

Заведующий обеспечивающей каф. КИБЭВС _____ А. А. Шелупанов

Рабочая программа дисциплины согласована с факультетом и выпускающей кафедрой:

Декан ЗиВФ _____ И. В. Осипов

Заведующий выпускающей каф. КИБЭВС _____ А. А. Шелупанов

Эксперты:

Доцент кафедры комплексной информационной безопасности электронно-вычислительных систем (КИБЭВС) _____ А. А. Конев

Доцент кафедры комплексной информационной безопасности электронно-вычислительных систем (КИБЭВС) _____ К. С. Сарин

Согласована на портале № 51644

1. Цели и задачи дисциплины

1.1. Цели дисциплины

дать понятие о существующих методах анализа и обработки многомерных статистических данных

1.2. Задачи дисциплины

– рассмотреть существующие методы для анализа значительных объемов многомерных данных;

– изучить методы поиска закономерностей в таких данных, методы их разбиения на классы;

– получить практические навыки по применению таких методов на практике для анализа массивов финансовых данных.

2. Место дисциплины в структуре ОПОП

Дисциплина «Макростатистический анализ и прогнозирование» (Б1.Б.05.06) относится к блоку 1 (базовая часть).

Предшествующими дисциплинами, формирующими начальные знания, являются: Алгебра, Информатика, Математический анализ, Системный анализ, Статистика, Макростатистический анализ и прогнозирование.

Последующими дисциплинами являются: Математические методы в задачах финансового мониторинга, Научно-исследовательская работа, Преддипломная практика, Макростатистический анализ и прогнозирование.

3. Требования к результатам освоения дисциплины

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:

– ПК-36 способностью составлять прогнозы динамики основных экономических показателей деятельности хозяйствующих субъектов ;

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

– **знать** основы проведения макростатистического анализа функционирования субъектов финансового мониторинга; основные алгоритмы и методы прогнозирования динамики и тенденций функционирования субъектов финансового мониторинга

– **уметь** формулировать и решать с применением методов оптимизации задачи математической обработки многомерных информационных массивов; выполнять анализ кластеров динамических информационных объектов

– **владеть** навыками выполнения прогнозных оценок поведения динамических информационных объектов и субъектов финансового мониторинга; навыками решения типовых информационно-расчетных задач финансового мониторинга

4. Объем дисциплины и виды учебной работы

Общая трудоемкость дисциплины составляет 6.0 зачетных единицы и представлена в таблице 4.1.

Таблица 4.1 – Трудоемкость дисциплины

Виды учебной деятельности	Всего часов	Семестры		
		7 семестр	8 семестр	9 семестр
Аудиторные занятия (всего)	20	8	8	4
Лекции	6	4	2	0
Практические занятия	10	4	6	0
Контроль самостоятельной работы (курсовой проект / курсовая работа)	4	0	0	4
Самостоятельная работа (всего)	187	64	91	32
Выполнение курсового проекта / курсовой работы	46	0	14	32

Согласована на портале № 51644

Выполнение домашних заданий	16	8	8	0
Проработка лекционного материала	32	16	16	0
Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	61	36	25	0
Подготовка к практическим занятиям, семинарам	12	4	8	0
Выполнение контрольных работ	20	0	20	0
Всего (без экзамена)	207	72	99	36
Подготовка и сдача экзамена	9	0	9	0
Общая трудоемкость, ч	216	72	108	36
Зачетные Единицы	6.0			

5. Содержание дисциплины

5.1. Разделы дисциплины и виды занятий

Разделы дисциплины и виды занятий приведены в таблице 5.1.

Таблица 5.1 – Разделы дисциплины и виды занятий

Названия разделов дисциплины	Лек., ч	Прак. зан., ч	КП/КР, ч	Сам. раб., ч	Всего часов (без экзамена)	Формируемые компетенции
7 семестр						
1 Сравнение методов прогнозирования	1	0	0	18	19	ПК-36
2 Ряды динамики в экономических задачах. Кривые роста.	3	4	0	46	53	ПК-36
Итого за семестр	4	4	0	64	72	
8 семестр						
3 Адаптивные модели временных рядов	1	4	0	59	64	ПК-36
4 Прогнозирование развития отраслей и сфер национальной экономики	1	2	0	18	21	ПК-36
5 Сбор и подготовка данных для курсовой работы	0	0	0	14	14	ПК-36
Итого за семестр	2	6	0	91	99	
9 семестр						
6 Выполнение расчетов и анализ полученных результатов.	0	0	4	20	20	ПК-36
7 Подготовка пояснительной записки	0	0		12	12	ПК-36
Итого за семестр	0	0	4	32	36	
Итого	6	10	4	187	207	

Согласована на портале № 51644

5.2. Содержание разделов дисциплины (по лекциям)

Содержание разделов дисциплин (по лекциям) приведено в таблице 5.2.

Таблица 5.2 – Содержание разделов дисциплин (по лекциям)

Названия разделов	Содержание разделов дисциплины (по лекциям)	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
7 семестр			
1 Сравнение методов прогнозирования	Интуитивные методы прогнозирования - методы индивидуальных и коллективных экспертных оценок. Формализованные методы прогнозирование - применение математической статистики.	1	ПК-36
	Итого	1	
2 Ряды динамики в экономических задачах. Кривые роста.	Понятие временных рядов. Предварительный анализ данных. Построение кривой роста. Оценка качества модели: значимость и точность модели. Прогнозирование с помощью кривой роста.	3	ПК-36
	Итого	3	
Итого за семестр		4	
8 семестр			
3 Адаптивные модели временных рядов	Адаптивные модели: методы экспоненциального сглаживания, авторегрессионные модели.	1	ПК-36
	Итого	1	
4 Прогнозирование развития отраслей и сфер национальной экономики	Прогнозирование базовых условий социально-экономического развития. Прогнозирование развития материального производства. Прогнозирование социального развития.	1	ПК-36
	Итого	1	
Итого за семестр		2	
Итого		6	

5.3. Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами

Разделы дисциплины и междисциплинарные связи с обеспечивающими (предыдущими) и обеспечиваемыми (последующими) дисциплинами представлены в таблице 5.3.

Таблица 5.3 – Разделы дисциплины и междисциплинарные связи

Наименование дисциплин	№ разделов данной дисциплины, для которых необходимо изучение обеспечивающих и обеспечиваемых дисциплин						
	1	2	3	4	5	6	7
Предшествующие дисциплины							
1 Алгебра		+					
2 Информатика		+		+		+	
3 Математический анализ		+	+			+	
4 Системный анализ		+	+	+		+	

Согласована на портале № 51644

5 Статистика		+	+	+			
6 Макростатистический анализ и прогнозирование	+	+	+	+	+	+	+
Последующие дисциплины							
1 Математические методы в задачах финансового мониторинга		+	+				
2 Научно-исследовательская работа		+	+				
3 Преддипломная практика	+	+	+	+			
4 Макростатистический анализ и прогнозирование	+	+	+	+	+	+	+

5.4. Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий представлено в таблице 5.4.

Таблица 5.4 – Соответствие компетенций, формируемых при изучении дисциплины, и видов занятий

Компетенции	Виды занятий				Формы контроля
	Лек.	Прак. зан.	КСР (КП/КР)	Сам. раб.	
ПК-36	+	+	+	+	Контрольная работа, Домашнее задание, Выполнение контрольной работы, Экзамен, Конспект самоподготовки, Защита курсовых проектов / курсовых работ, Отчет по курсовому проекту / курсовой работе, Тест

6. Интерактивные методы и формы организации обучения

Не предусмотрено РУП.

7. Лабораторные работы

Не предусмотрено РУП.

8. Практические занятия (семинары)

Наименование практических занятий (семинаров) приведено в таблице 8.1.

Таблица 8.1 – Наименование практических занятий (семинаров)

Названия разделов	Наименование практических занятий (семинаров)	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
7 семестр			
2 Ряды динамики в экономических задачах. Кривые роста.	Понятие временных рядов. Предварительный анализ данных. Построение кривой роста. Оценка качества модели: значимость и точность модели. Прогнозирование с помощью кривой роста.	4	ПК-36
	Итого	4	
Итого за семестр		4	
8 семестр			
3 Адаптивные модели	Адаптивные модели: методы экспоненци-	4	ПК-36

Согласована на портале № 51644

временных рядов	ального сглаживания, авторегрессионные модели, искусственные переменные.		
	Итого	4	
4 Прогнозирование развития отраслей и сфер национальной экономики	Прогнозирование базовых условий социально-экономического развития. Прогнозирование развития материального производства. Прогнозирование социального развития.	2	ПК-36
	Итого	2	
Итого за семестр		6	
Итого		10	

9. Самостоятельная работа

Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции представлены в таблице 9.1.

Таблица 9.1 – Виды самостоятельной работы, трудоемкость и формируемые компетенции

Названия разделов	Виды самостоятельной работы	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции	Формы контроля
7 семестр				
1 Сравнение методов прогнозирования	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	10	ПК-36	Конспект самоподготовки, Тест, Экзамен
	Проработка лекционного материала	8		
	Итого	18		
2 Ряды динамики в экономических задачах. Кривые роста.	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	4	ПК-36	Домашнее задание, Конспект самоподготовки, Тест, Экзамен
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	26		
	Проработка лекционного материала	8		
	Выполнение домашних заданий	8		
	Итого	46		
Итого за семестр		64		
8 семестр				
3 Адаптивные модели временных рядов	Выполнение контрольных работ	20	ПК-36	Выполнение контрольной работы, Домашнее задание, Конспект самоподготовки, Контрольная работа, Тест
	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	6		
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	15		

Согласована на портале № 51644

	Проработка лекционного материала	10		
	Выполнение домашних заданий	8		
	Итого	59		
4 Прогнозирование развития отраслей и сфер национальной экономики	Подготовка к практическим занятиям, семинарам	2	ПК-36	Защита курсовых проектов / курсовых работ, Отчет по курсовому проекту / курсовой работе, Тест, Экзамен
	Самостоятельное изучение тем (вопросов) теоретической части курса	10		
	Проработка лекционного материала	6		
	Итого	18		
5 Сбор и подготовка данных для курсовой работы	Выполнение курсового проекта / курсовой работы	14	ПК-36	Защита курсовых проектов / курсовых работ, Отчет по курсовому проекту / курсовой работе, Тест
	Итого	14		
Итого за семестр		91		
	Подготовка и сдача экзамена	9		Экзамен
9 семестр				
6 Выполнение расчетов и анализ полученных результатов.	Выполнение курсового проекта / курсовой работы	20	ПК-36	Защита курсовых проектов / курсовых работ, Отчет по курсовому проекту / курсовой работе, Тест
	Итого	20		
7 Подготовка пояснительной записки	Выполнение курсового проекта / курсовой работы	12	ПК-36	Защита курсовых проектов / курсовых работ, Отчет по курсовому проекту / курсовой работе, Тест
	Итого	12		
Итого за семестр		32		
Итого		196		

10. Курсовой проект / курсовая работа

Трудоемкость аудиторных занятий и формируемые компетенции в рамках выполнения курсового проекта / курсовой работы представлены таблице 10.1.

Таблица 10.1 – Трудоемкость аудиторных занятий и формируемые компетенции в рамках выполнения курсового проекта / курсовой работы

Наименование аудиторных занятий	Трудоемкость, ч	Формируемые компетенции
9 семестр		

Согласована на портале № 51644

Отбор данных. Подготовка данных к анализу.	1	ПК-36
Построение регрессионных и адаптивных моделей макроэкономических параметров	3	
Итого за семестр	4	

10.1. Темы курсовых проектов / курсовых работ

Примерная тематика курсовых проектов / курсовых работ:

- 1. Статистический анализ динамики среднемесячных макроэкономических показателей Российской Федерации.
- 2. Статистический анализ динамики макроэкономических показателей США.
- 3. Статистический анализ динамики макроэкономических показателей Великобритании.
- 4. Статистический анализ динамики макроэкономических показателей Франции.
- 5. Статистический анализ динамики макроэкономических показателей Италии.
- 6. Статистический анализ динамики индексов ведущих фондовых рынков.
- 7. Статистический анализ динамики курсов валют европейских стран.

11. Рейтинговая система для оценки успеваемости обучающихся

Рейтинговая система не используется.

12. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

12.1. Основная литература

1. Эконометрика [Электронный ресурс]: Учебное пособие / Потахова И. В. - 2015. 110 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/5205 (дата обращения: 02.07.2021).

2. Макроэкономическое планирование и прогнозирование [Электронный ресурс]: Учебное пособие / Е. В. Кулешова - 2015. 178 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/4952 (дата обращения: 02.07.2021).

12.2. Дополнительная литература

1. Ганичева, А.В. Прикладная статистика [Электронный ресурс]: учебное пособие [Электронный ресурс] : учеб. пособие / А.В. Ганичева. — Электрон. дан. — Санкт-Петербург : Лань, 2017. — 172 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/91890 (дата обращения: 02.07.2021).

2. Лукьяненко, И.С. Статистика [Электронный ресурс] [Электронный ресурс]: учеб. пособие / И.С. Лукьяненко, Т.К. Ивашковская. — Электрон. дан. — Санкт-Петербург : Лань, 2017. — 200 с. — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/93713 (дата обращения: 02.07.2021).

12.3. Учебно-методические пособия

12.3.1. Обязательные учебно-методические пособия

1. Лебедева, Т. В. Анализ временных рядов и бизнес-прогнозирование [Электронный ресурс]: учебно-методическое пособие / Т. В. Лебедева. — Оренбург : ОГУ, 2018. — 240 с. — ISBN 978-5-7410-2205-4. — Текст : электронный // Лань : электронно-библиотечная система — Режим доступа: https://e.lanbook.com/book/159738 (дата обращения: 02.07.2021).

2. Макроэкономическое планирование и прогнозирование [Электронный ресурс]: Методические указания по проведению лабораторных и самостоятельных работ / М. Г. Сидоренко - 2018. 45 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/7995 (дата обращения: 02.07.2021).

3. Макроэкономика [Электронный ресурс]: Методические указания по выполнению курсовой работы / Л. А. Алферова - 2018. 48 с. — Режим доступа: https://edu.tusur.ru/publications/7163 (дата обращения: 02.07.2021).

12.3.2. Учебно-методические пособия для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Учебно-методические материалы для самостоятельной и аудиторной работы обучающихся из числа лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предоставляются в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации.

Для лиц с нарушениями зрения:

- в форме электронного документа;

Согласована на портале № 51644

– в печатной форме увеличенным шрифтом.

Для лиц с нарушениями слуха:

– в форме электронного документа;

– в печатной форме.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

– в форме электронного документа;

– в печатной форме.

12.4. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. http://www.edu.tusur.ru – образовательный портал университета;
2. http://www.lib.tusur.ru - электронная библиотека ТУСУР;
3. http://www.elibrary.ru – научная электронная библиотека
4. https://e.lanbook.com/ - электронная библиотечная система учебной и научной литературы

12.5. Периодические издания

1. Международный эконометрический журнал на русском языке «Квантиль» [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://elibrary.ru/title_about.asp?id=28526 (дата обращения: 02.07.2021).
2. Научно-практический журнал "Прикладная эконометрика" [Электронный ресурс]: — Режим доступа: https://elibrary.ru/title_about.asp?id=25180 (дата обращения: 02.07.2021).

13. Материально-техническое обеспечение дисциплины и требуемое программное обеспечение

13.1. Общие требования к материально-техническому и программному обеспечению дисциплины

13.1.1. Материально-техническое и программное обеспечение для лекционных занятий

Для проведения занятий лекционного типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации используется учебная аудитория с количеством посадочных мест не менее 22-24, оборудованная доской и стандартной учебной мебелью. Имеются демонстрационное оборудование и учебно-наглядные пособия, обеспечивающие тематические иллюстрации по лекционным разделам дисциплины.

13.1.2. Материально-техническое и программное обеспечение для практических занятий

Учебная аудитория / Лекционная аудитория с интерактивным проектором и маркерной доской

учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, учебная аудитория для проведения занятий практического типа, учебная аудитория для проведения занятий семинарского типа, помещение для проведения групповых и индивидуальных консультаций, помещение для проведения текущего контроля и промежуточной аттестации

634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 401 ауд.

Описание имеющегося оборудования:

- Доска TraceBoard TS-408L;
- Мультимедийный проектор ViewSonic PJD5154 DLP;
- Ноутбук Lenovo Think Pad E530c;
- Комплект специализированной учебной мебели;
- Рабочее место преподавателя.

Программное обеспечение:

– Google Chrome

– Microsoft Windows

– OpenOffice

13.1.3. Материально-техническое и программное обеспечение для самостоятельной работы

Для самостоятельной работы используются учебные аудитории (компьютерные классы),

Согласована на портале № 51644

расположенные по адресам:

- 634050, Томская область, г. Томск, Ленина проспект, д. 40, 233 ауд.;
- 634045, Томская область, г. Томск, ул. Красноармейская, д. 146, 201 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 47, 126 ауд.;
- 634034, Томская область, г. Томск, Вершинина улица, д. 74, 207 ауд.

Состав оборудования:

- учебная мебель;
- компьютеры класса не ниже ПЭВМ INTEL Celeron D336 2.8ГГц. - 5 шт.;
- компьютеры подключены к сети «Интернет» и обеспечивают доступ в электронную информационно-образовательную среду университета.

Перечень программного обеспечения:

- Microsoft Windows;
- OpenOffice;
- Kaspersky Endpoint Security 10 для Windows;
- 7-Zip;
- Google Chrome.

13.2. Материально-техническое обеспечение дисциплины для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Освоение дисциплины лицами с ограниченными возможностями здоровья и инвалидами осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями слуха** предусмотрено использование звукоусиливающей аппаратуры, мультимедийных средств и других технических средств приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы преподавания для обучающихся с инвалидностью, портативной индукционной системы. Учебная аудитория, в которой занимаются обучающиеся с нарушением слуха, оборудована компьютерной техникой, аудиотехникой, видеотехникой, электронной доской, мультимедийной системой.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями зрениями** предусмотрено использование в лекционных и учебных аудиториях возможности просмотра удаленных объектов (например, текста на доске или слайда на экране) при помощи видеоувеличителей для комфортного просмотра.

При занятиях с обучающимися **с нарушениями опорно-двигательного аппарата** используются альтернативные устройства ввода информации и другие технические средства приема/передачи учебной информации в доступных формах, мобильной системы обучения для людей с инвалидностью.

14. Оценочные материалы и методические рекомендации по организации изучения дисциплины

14.1. Содержание оценочных материалов и методические рекомендации

Для оценки степени сформированности и уровня освоения закрепленных за дисциплиной компетенций используются оценочные материалы в составе:

14.1.1. Тестовые задания

1) Для некоторой величины рассчитана регрессионная модель по трем факторам, влияющим на нее. Какой коэффициент покажет вклад второго фактора в суммарное влияние всех учтенных факторов?

1. бета-коэффициент
2. множественный коэффициент корреляции
3. дельта-коэффициент
4. коэффициент эластичности

2) Для исследуемой величины построены две различные регрессионные модели. Обе модели адекватны. Какую модель выберем для дальнейшего анализа и прогнозирования?

1. модель с меньшей ошибкой (более точную)
2. более сложную модель

Согласована на портале № 51644

3. модель с гетероскедастичностью

4. модель с мультиколлинеарностью

3) Для некоторой исследуемой величины построена регрессионная модель по трем факторам. С помощью какого критерия можно проверить гипотезу о значимости каждого коэффициента регрессии?

1. критерий Стьюдента

2. критерий Ирвина

3. критерий Дарбина-Уотсона

4. критерий Фишера

4)Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. С помощью какого коэффициента корреляции можно оценить связь двух из них между собой при фиксации влияния остальных факторов?

1. множественный коэффициент корреляции

2. множественный коэффициент детерминации

3. частный коэффициент корреляции

4. парный коэффициент корреляции

5) Проводится анализ динамики некоторого экономического показателя по выборке длиной 60. Известно, что на этот показатель, возможно, влияют три независимых фактора. Множественный коэффициент корреляции, рассчитанный для показателя и этих трех факторов вместе, равен 0.99. Какой вывод можно сделать о силе совместного влияния выбранных факторов на исследуемый показатель?

1. вывод сделать нельзя, коэффициент не характеризует силу такой связи

2. влияние факторов на исследуемый показатель слабое

3. влияние факторов на исследуемый показатель сильное

4. факторы незначимо влияют на исследуемый показатель

6) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для одного из них построена регрессионная модель относительно нескольких других факторов. Для каждого фактора рассчитана эластичность по отношению к зависимой величине. Для одного фактора эластичность равна 0.5. Что это означает?

1. если среднее значение зависимой величины увеличится на 1 %, то среднее значение фактора увеличится на 0.5 %

2. если среднее значение фактора увеличится на 1 %, то среднее значение зависимой величины увеличится на 0.5 %

3. если среднее значение зависимой величины увеличится на 1 %, то среднее значение фактора уменьшится на 0.5 %

4. если среднее значение фактора увеличится на 1 %, то среднее значение зависимой величины уменьшится на 0.5 %

7) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для одного из них построена регрессионная модель относительно другого фактора. При проверке гипотезы о незначимости коэффициента детерминации, рассчитанного для этой модели, на уровне значимости 0.05 p-значение оказалось меньше 0.05. Основываясь на этой информации, какой вывод можно сделать относительно значимости коэффициента?

1. это зона неопределенности, нужны дополнительные исследования

2. по p-значению нельзя сделать никакого вывода

3. гипотезу отвергаем, коэффициент значим

4. гипотезу принимаем, коэффициент незначим

8) Для некоторой исследуемой величины построена регрессионная модель по трем факторам. С помощью какого критерия можно проверить гипотезу о значимости коэффициента детерминации, рассчитанного для этой модели?

1. критерий Ирвина

2. критерий Дарбина-Уотсона

3. критерий Фишера

4. критерий Стьюдента

9) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для

Согласована на портале № 51644

одного из них строим регрессионную модель относительно другого фактора с помощью средства Регрессия надстройки Анализ данных в Microsoft Office. Что означает пункт "Константа-ноль" в настройках средства?

1. свободный член в уравнении регрессии полагается равным нулю
2. коэффициент при независимой переменной полагается равным нулю
3. коэффициент детерминации для уравнения полагается равным нулю
4. доверительная вероятность полагается равной нулю

10) Для некоторой исследуемой величины построена регрессионная модель по трем факторам и рассчитаны остатки для каждого наблюдения. С помощью какого критерия можно проверить, удовлетворяют ли остатки условию независимости (то есть в шуме нет временного тренда)?

1. критерий Дарбина-Уотсона
2. критерий Фишера
3. критерий Стьюдента
4. критерий Ирвина

11) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для одного из них построена регрессионная модель относительно другого фактора. В рамках проверки качества модели необходимо проверить нормальность распределения ряда остатков регрессии. Почему при анализе нормальности применяется критерий, в котором исследуется значимость асимметрии и эксцесса для ряда остатков?

1. у нормально распределенной последовательности асимметрия и эксцесс велики
2. у нормально распределенной последовательности асимметрия равна нулю, а эксцесс велик
3. у нормально распределенной последовательности асимметрия велика, а эксцесс равен нулю
4. у нормально распределенной последовательности асимметрия и эксцесс равны нулю

12) Для некоторой исследуемой величины построена регрессионная модель по трем факторам и рассчитаны остатки для каждого наблюдения. С помощью какого критерия можно проверить, удовлетворяют ли остатки условию гомоскедастичности?

1. критерий Стьюдента
2. критерий Ирвина
3. критерий Дарбина-Уотсона
4. критерий Голдфельда-Квандта

13) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для одного из них построена регрессионная модель относительно другого фактора. Построим по этой модели два доверительных интервала для прогнозного значения зависимой величины с одним и тем же значением фактора, но разным уровнем значимости - 0.05 и 0.1. Для какого уровня значимости интервал будет шире?

1. 0.1
2. ничего нельзя сказать - нужны дополнительные сведения
3. 0.05
4. они будут одинаковы, так как уровень значимости никак не влияет на ширину доверительного интервала прогноза

14) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. С помощью какого коэффициента корреляции можно оценить связь двух из них между собой (никак не учитывая влияние других факторов)?

1. дельта-коэффициент
2. частный коэффициент корреляции
3. коэффициент автокорреляции
4. парный коэффициент корреляции

15) Исследуется некоторая величина и факторы, влияющие на нее. В процессе регрессионного анализа обнаружено, что факторы имеют сильную линейную зависимость. Как называется это явление?

1. гетероскедастичность
2. мультиколлинеарность

Согласована на портале № 51644

3. однородность

4. несмещенность

16) Если при построении регрессионной модели для некоторой величины в остатках обнаружена гетероскедастичность, то каковы негативные последствия этого условия?

1. гетероскедастичность - необходимое условие для остатков уравнения регрессии, негативных последствий оно не несет

2. наличие гетероскедастичности в остатках приводит к тому, что среднее значение шума становится значимо отличным от нуля и результаты моделирования смещаются

3. наличие гетероскедастичности в остатках приводит к наличию больших выбросов, что ухудшает качество модели

4. наличие гетероскедастичности в остатках приводит к тому, что в уравнении регрессии неучтена часть влияния фактора

17) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для одного из них построена регрессионная модель относительно нескольких других факторов. Для каждого фактора рассчитан бета-коэффициент по отношению к зависимой величине. Для одного фактора бета-коэффициент равен 2. Что это означает?

1. если значение фактора увеличится на свое СКО, то зависимая величина увеличится на 2 своих СКО

2. если значение фактора увеличится на свое СКО, то зависимая величина уменьшится на 2 своих СКО

3. если зависимая величина увеличится на свое СКО (среднеквадратическое отклонение), то значение фактора увеличится на 2 своих СКО

4. если значение фактора увеличится на свое СКО, то зависимая величина увеличится в 2 раза

18) Если для двух выборок длиной 100 коэффициент корреляции равен 0.99, какой вывод можно сделать об их связи?

1. связь сильная прямая

2. этот коэффициент не несет информации о силе связи

3. связь сильная обратная

4. связь незначима

19) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. С помощью какого коэффициента можно оценить влияние нескольких факторов одновременно на одну изучаемую величину?

1. дельта-коэффициент

2. множественный коэффициент корреляции

3. частный коэффициент корреляции

4. коэффициент автокорреляции

20) Рассматриваются несколько факторов, необходимо исследовать связь между ними. Для одного из них построена регрессионная модель относительно другого фактора. Уравнение регрессии выглядит следующим образом: $y=-9.89+10.56x$.

Что можно сказать об этом уравнении?

1. результаты неверны - свободный член не может быть отрицательным

2. пока все корректно, модель можно исследовать дальше

3. результаты неверны - коэффициенты регрессии могут принимать значения только в интервале [0; 1]

4. результаты неверны - коэффициенты регрессии могут принимать значения только в интервале [-1; 1]

14.1.2. Экзаменационные вопросы

1) Предварительный анализ данных (проверка наличия аномалий, проверка наличия тренда, виды сглаживания, расчет показателей)

2) Построение модели временного ряда (виды моделей, метод наименьших квадратов)

3) Оценка качества модели (условия Гаусса-Маркова, абсолютные и относительные ошибки)

4) Модель Брауна, подбор оптимальных параметров

Согласована на портале № 51644

5) Точечный и интервальный прогноз.

6) Задача корреляционного анализа. Ковариация, дисперсия.

7) Коэффициент парной корреляции. Шкала Чеддока. Оценка значимости коэффициента корреляции. Матрица коэффициентов парной корреляции.

8) Многомерный корреляционный анализ: множественный коэффициент корреляции, выборочный множественный коэффициент детерминации, оценка значимости коэффициента детерминации; выборочный частный коэффициент корреляции.

9) Задача регрессионного анализа.

10) Формулировка линейной регрессионной задачи для случая одного фактора, объяснение коэффициентов.

11) Оценка параметров линейного уравнения парной регрессии. Метод наименьших квадратов.

12) Условия Гаусса-Маркова (5 условий). Смысл соблюдения этих условий.

13) Оценка качества уравнения регрессии. Проверка адекватности модели регрессии (коэффициент детерминации, проверка значимости коэффициента детерминации, проверка значимости коэффициентов регрессионной модели). Оценка точности модели (средняя относительная и средняя абсолютная ошибки аппроксимации).

14) Построение прогноза с применением линейного уравнения парной регрессии (точечный и интервальный прогнозы).

15) Формулировка линейной регрессионной задачи для случая нескольких факторов, объяснение коэффициентов.

16) Оценка параметров линейного уравнения множественной регрессии. Метод наименьших квадратов.

17) Эластичность, бета- и дельта-коэффициенты.

18) Построение прогноза с применением линейного уравнения множественной регрессии (точечный и интервальный прогнозы).

19) Нелинейная регрессия.

14.1.3. Вопросы на самоподготовку

Методы индивидуальных экспертных оценок: анкетирование, интервьюирование, сценарии.

Методы коллективных экспертных оценок: метод "комиссий", метод "Дельфи", метод "коллективной генерации идей", метод морфологического анализа.

Предварительный анализ данных: проверка наличия аномалий, проверка наличия тренда, сглаживание ряда, коэффициент автокорреляции, исследование коррелограммы и автокорреляционной функции, вычисление статистических показателей (прирост, темп роста, темп прироста).

Построение модели кривой роста, метод наименьших квадратов. Определение сезонной и циклической составляющей, декомпозиция ряда.

Оценка качества модели: коэффициент детерминации, проверка условий Гаусса-Маркова, точность модели. Проблема устранения автокорреляции ошибок. Прогнозирование ряда с помощью кривой роста и адаптивных моделей.

Адаптивные модели: методы экспоненциального сглаживания, авторегрессионные модели. Построение модели Брауна, выбор оптимальных параметров.

Прогнозирование базовых условий социально-экономического развития. Прогнозирование развития материального производства. Прогнозирование социального развития.

14.1.4. Темы домашних заданий

Построить кривую роста для уровня безработицы, проверить качество модели, устранить наличие автокорреляции.

Выполнить декомпозицию временного ряда значений темпа роста промышленного производства.

Построить для временного ряда следующие модели: авторегрессионную 2-го порядка, модель Брауна, Хольта, Винтерса.

14.1.5. Темы контрольных работ

Построить для макроэкономического временного ряда кривую роста и адаптивные модели. Выбрать наиболее подходящую и объяснить свой выбор

Согласована на портале № 51644

14.1.6. Темы курсовых проектов / курсовых работ

1. Статистический анализ динамики и взаимозависимости среднемесячных макроэкономических показателей Российской Федерации.
2. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей США.
3. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей Великобритании.
4. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей Франции.
5. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей Италии.
6. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей Китая.
7. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей Японии.
8. Статистический анализ динамики и взаимозависимости макроэкономических показателей Южной Кореи.

14.2. Требования к оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусмотрены дополнительные оценочные материалы, перечень которых указан в таблице 14.

Таблица 14 – Дополнительные материалы оценивания для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Категории обучающихся	Виды дополнительных оценочных материалов	Формы контроля и оценки результатов обучения
С нарушениями слуха	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы	Преимущественно письменная проверка
С нарушениями зрения	Собеседование по вопросам к зачету, опрос по терминам	Преимущественно устная проверка (индивидуально)
С нарушениями опорно-двигательного аппарата	Решение дистанционных тестов, контрольные работы, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету	Преимущественно дистанционными методами
С ограничениями по общемедицинским показаниям	Тесты, письменные самостоятельные работы, вопросы к зачету, контрольные работы, устные ответы	Преимущественно проверка методами исходя из состояния обучающегося на момент проверки

14.3. Методические рекомендации по оценочным материалам для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов

Для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов предусматривается доступная форма предоставления заданий оценочных средств, а именно:

- в печатной форме;
- в печатной форме с увеличенным шрифтом;
- в форме электронного документа;
- методом чтения ассистентом задания вслух;
- предоставление задания с использованием сурдоперевода.

Лицам с ограниченными возможностями здоровья и инвалидам увеличивается время на подготовку ответов на контрольные вопросы. Для таких обучающихся предусматривается доступная форма предоставления ответов на задания, а именно:

- письменно на бумаге;
- набор ответов на компьютере;

Согласована на портале № 51644

– набор ответов с использованием услуг ассистента;
– представление ответов устно.

Процедура оценивания результатов обучения лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов по дисциплине предусматривает предоставление информации в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья и восприятия информации:

Для лиц с нарушениями зрения:

– в форме электронного документа;
– в печатной форме увеличенным шрифтом.

Для лиц с нарушениями слуха:

– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

Для лиц с нарушениями опорно-двигательного аппарата:

– в форме электронного документа;
– в печатной форме.

При необходимости для лиц с ограниченными возможностями здоровья и инвалидов процедура оценивания результатов обучения может проводиться в несколько этапов.

Согласована на портале № 51644