

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Таскаев Сергей Васильевич
Должность: Ректор
Дата подписания: 15.09.2025 11:13:06
Уникальный программный ключ:
04c19ed8bfb98f3b6cb77a486b9a8768085225d3



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

| | | | |
|---|--------------|------------------------|---------------|
| Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование» по направлению подготовки 01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный интеллект» ФГБОУ ВО «ЧелГУ» | | | |
| Версия документа - 1 | стр. 1 из 10 | Первый экземпляр _____ | КОПИЯ № _____ |

**Фонд оценочных средств
для промежуточной аттестации
по дисциплине (модулю)
Эконометрическое моделирование**

Направление подготовки (специальность)
01.03.02 Прикладная математика и информатика

Направленность (профиль)
Прикладная математика и искусственный интеллект

Присваиваемая квалификация (степень)
бакалавр

Форма обучения
очная

Челябинск 2025 г.

Эконометрическое моделирование

Направление подготовки (специальность)

01.03.02 Прикладная математика и информатика

Направленность (профиль)

Прикладная математика и искусственный интеллект

Год набора 2025

Форма обучения очная

Фонд оценочных средств дисциплины (модуля) одобрен и рекомендован:

Проректор по учебной работе

утверждено 24.02.25

А.А. Саламатов

Ученым советом математического факультета

Протокол заседания № 6 от 20.02.2025

Председатель Ученого совета

математического факультета

согласовано

Е.А. Сбродова

Заседанием кафедры вычислительной математики

Протокол заседания № 9 от 20.02.2025

Заведующий кафедрой

согласовано

В. Н. Павленко

Автор (составитель)

Н. Д. Пазий

Структура рабочей программы соответствует приказу ректора ФГБОУ ВО «ЧелГУ» от «13» апреля 2021 г. № 247-1



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 2 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

1. ПАСПОРТ ФОНДА ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

Направление 01.03.02 Прикладная математика и информатика

Семестры изучения: 7 семестр.

Формы промежуточной аттестации: экзамен

Примечание: для оценивания результатов используется балльно-рейтинговая система.

2. ПЕРЕЧЕНЬ ФОРМИРУЕМЫХ КОМПЕТЕНЦИЙ

2.1. Компетенции, закреплённые за дисциплиной

Изучение дисциплины направлено на формирование следующих компетенций:

| Коды компетенции согласно ФГОС (ОПОП ВО) | Содержание компетенций согласно ФГОС (ОПОП ВО) | Индикаторы достижения компетенции согласно ОПОП | Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине |
|--|---|---|--|
| 1 | 2 | 3 | 4 |
| ПК-1 | Обладает знаниями о существующих математических методах и моделях, применяемые для описания систем; о классических математических методах анализа систем. | ПК-1.1. Обладает знаниями о существующих математических методах и моделях, применяемые для описания систем; о классических математических методах анализа систем. ПК-1.2. Демонстрирует умение: проводить исследование и анализ системы; интерпретировать результаты анализа для заинтересованных лиц; устанавливать причинно-следственные связи между явлениями; проводить сбор, обработку и анализ данных для определения ключевых свойств системы. ПК-1.3. Имеет практический опыт (навыки): вы- | Знать: основные методы обработки экономической информации построения математических моделей и анализа полученных моделей -основные понятия и теоремы эконометрического моделирования Уметь: обрабатывать большие объемы экономических данных -применять регрессионный анализ для построения эконометрических моделей. Владеть: способами отбора наиболее адекватных моделей -создания оценки эконометрических моделей. |



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 3 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

| | | | |
|--|--|--|--|
| | | полнения описания модели системы; применения математических методов при решении типовых задач; выполнения классификации явлений системы и описания причинно-следственных связей между явлениями. | |
|--|--|--|--|



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 4 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

3.1 Содержание оценочных средств для текущей аттестации

| № п/п | Код компетенции/ планируемые результаты обучения | Контролируемые темы/ разделы | Наименование оценочного средства для текущего контроля | Наименование оценочного средства на промежуточной аттестации/№ задания |
|-------|---|--|---|---|
| 1 | ПК-1: способность собирать, обрабатывать и интерпретировать данные современных научных исследований, необходимые для формирования выводов по соответствующим научным исследованиям технологии | Раздел 1. Основные понятия | Лабораторная работа «Вводное занятие» | Вопросы для экзамена |
| 2 | ПК-1: способность собирать, обрабатывать и интерпретировать данные современных научных исследований, необходимые для формирования выводов по соответствующим научным исследованиям | Раздел 2. Линейные нормальные регрессионные модели | Лабораторные работы 1-4, Отчет о выполненной самостоятельной работе | Вопросы для экзамена |
| 3 | ПК-1: способность собирать, обрабатывать и интерпретировать данные современных научных исследований, необходимые для формирования выводов по соответствующим научным исследованиям | Раздел 3. Временные ряды | Лабораторная работа 5, 6 Отчеты о выполненной самостоятельной работе | Вопросы для экзамена |

Примечание: Типовые задания, критерии и показатели оценивания в рамках текущего



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 5 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

контроля представлены в рабочей программе дисциплины (модуля). Полные комплекты оценочных средств и контрольно-измерительных материалов хранятся на кафедре.

Лабораторные работы:

"Основы работы с пакетом EViews"

Обучение простейшим навыкам работы с пакетом (создание, удаление серий заданного объема, арифметические операции с ними, вычисление выборочных дисперсий и матожидания и т.п.).

"Парная регрессия"

Построение регрессионных оценок МНК, вычисление, доверительные интервалы.

"Множественная регрессия"

Закрепление понятия множественной регрессии, использование возможностей пакета EViews для построения регрессионного уравнения, интерпретация, оценка тесноты связи, качества приближения.

"Мультиколлинеарность. Метод исключения"

Понятие мультиколлинеарности, ее выявление, работа с мультиколлинеарными наблюдениями, метод исключения.

"Гетероскедастичность и автокорреляция".

Понятие гомо- и гетероскедастичности, признаки, выявление с помощью пакета EViews, тест Голдфелда-Куандта. Выявление автокорреляции, тест Дарбина-Уотсона.

"Коррекция на гетероскедастичность"

При выявлении гетероскедастичности тестом Вальда сделать коррекцию на ее наличие, меняя модель на логарифмическую, полупологарифмическую и/или другую, более подходящую.

Типы самостоятельных заданий:

Задание 1.

По данным о банках России построить модель множественной регрессии. Проанализировать полученную модель.

Задание 2.

По данным о рынке жилья в Санкт-Петербурге построить модель множественной регрессии. Проанализировать ее.

Для промежуточной аттестации



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 6 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

Вопросы к экзамену

1. Основные этапы эконометрического моделирования.
2. Типы эконометрических моделей.
3. Спецификация вида функциональной зависимости для однофакторной регрессионной модели.
4. Оценивание методом наименьших квадратов (МНК) неизвестных параметров однофакторной регрессионной модели, вывод явного вида МНК оценок коэффициентов однофакторной регрессионной модели.
5. Однофакторная нормальная классическая линейная регрессионная модель: интервальное оценивание коэффициентов, проверка гипотез о значимости коэффициента регрессии и о значимости модели в целом, прогнозирование.
6. Особенности оценивания линеаризуемых регрессионных однофакторных моделей.
7. Как оценивается качество подгонки выбранной однофакторной регрессии под исходные статистические данные?
8. Особенности спецификации множественной регрессии. Процедура «включения-исключения» отбора факторов, включаемых в модель множественной регрессии.
9. Мультиколлинеарность факторов, ее проявления. Исключение дублирующих факторов, тест на мультиколлинеарность.
10. метод наименьших квадратов для линейной множественной регрессии, условие единственности МНК оценки и вывод ее явного вида.
11. Геометрический смысл МНК оценки коэффициентов линейной множественной регрессии. Доказать, что остатки линейной регрессии не коррелируют с регрессорами (в смысле равенства нулю выборочного коэффициента корреляции). Содержательная интерпретация этого факта.
12. Разложение вариации результирующего признака линейной множественной регрессии на остаточную дисперсию и объясненную регрессией сумму квадратов. Коэффициент детерминации линейной регрессии как оценка качества подбора модели под исходные данные. Доказать, что при добавлении регрессоров в линейную регрессионную модель ее коэффициент детерминации не уменьшается. Скорректированный коэффициент детерминации и его свойства.
13. Содержательная интерпретация коэффициентов линейной регрессии. Почему нельзя сравнивать влияние факторов линейной модели на результирующий признак по модулю соответствующий коэффициентов регрессии? Как можно сравнить такие влияния?
14. Степенные модели множественной регрессии, экономическая интерпретация их параметров. Как можно сравнить влияние различных факторов такой модели на результирующий признак?
15. Нормальная классическая множественная регрессия: свойства МНК оценки коэффициентов регрессии, интервальное оценивание коэффициентов регрессии, проверка статистических гипотез о коэффициентах модели (о значимости



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 7 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

коэффициентов регрессии, о значимости модели в целом, о линейных ограничениях).

16. Короткая и длинная регрессии, тест Чоу.
17. Линейная классическая множественная регрессия, теорема Гаусса-Маркова.
18. Обобщенный МНК, теорема Айткена и оценка доступного обобщенного МНК.
19. Гетероскедастичность в линейных регрессионных моделях, ее последствия при оценивании коэффициентов МНК. Тесты на гетероскедастичность и методы ее устранения.
20. Линейная регрессионная модель с корреляцией по времени: вычисление ковариационной матрицы вектора ошибок регрессии, построение оценок коэффициентов регрессии более эффективных чем оценки МНК, тест Дарбина-Уотсона.
21. Условное и безусловное прогнозирование для нормальной классической линейной регрессионной модели.
22. Прогнозирование для линейных регрессионных моделей с корреляцией по времени.
23. Исследование фиктивных переменных для количественной оценки влияния качественных факторов на результирующий признак.
24. Метод главных компонент для классической нормальной линейной регрессии.

Пример экзаменационного билета

Билет № 1

1. Метод максимального правдоподобия
2. Гетероскедастичность. Тесты по выявлению гетероскедастичности.
3. По данным курса евро-доллар построить ARMA или ARIMA модель и проверить ее адекватность.

4. ПОРЯДОК ПРОВЕДЕНИЯ И КРИТЕРИИ ОЦЕНИВАНИЯ ПРОМЕЖУТОЧНОЙ АТТЕСТАЦИИ

4.1. Порядок проведения промежуточной аттестации

Во время обучения студенту предлагается 6 лабораторных работ и два самостоятельных задания. Максимальный балл за каждую лабораторную работу и выполненное самостоятельное задание — 10 баллов.

Критерии оценивания лабораторных//самостоятельных заданий:



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 8 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

| Балл | 8-10 баллов | 6-7 баллов | 4-5 баллов | 0-3 баллов |
|--|--|---------------------------------|---|--|
| Уровень освоения проверяемых компетенций | высокий | средний | базовый | недостаточный |
| Критерии оценивания | Построена и проанализирована правильная модель | Анализ модели проведен не точно | Анализ модели сделан с большими недочетами. | Даны только начальные этапы решения задачи |

Критерии оценивания ответа на экзамене

Максимальный балл за ответ — 20 баллов. Этот балл складывается из баллов, полученных за каждый теоретический вопрос. В билете – 1 теоретический вопрос с доказательством и 2 теоретических вопроса без доказательства.

Критерии оценивания теоретического вопроса с доказательством Максимальный балл — 10.

| 9-10 баллов | 6-8 балла | 3-6- баллов | 0-2 балла |
|--|---|--|---|
| Высокий уровень освоения проверяемых компетенций | Средний уровень освоения проверяемых компетенций | Базовый уровень освоения проверяемых компетенций | Недостаточный уровень освоения проверяемых компетенций |
| Даны аккуратные определения и подробные доказательства теорем, свойств. Объяснены все обозначения, участвующие в ответе. | Даны определения и доказательства теорем, свойств. Не объяснены некоторые обозначения. Возможны незначительные неясности в изложении. | Определения и доказательства в целом приведены, но содержат незначительные неточности, недостаточная ясность изложения. Возможно, не приведены доказательства. | Ответ на вопрос отсутствует или содержит определения и формулировки, содержащие значительные ошибки |

Критерии оценивания теоретического вопроса без доказательства Максимальный балл — 5.



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 9 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

| 5 баллов | 4 балла | 3 баллов | 0-2 балла |
|--|--|--|---|
| Высокий уровень освоения проверяемых компетенций | Средний уровень освоения проверяемых компетенций | Базовый уровень освоения проверяемых компетенций | Недостаточный уровень освоения проверяемых компетенций |
| Даны аккуратные определения и формулировки теорем, свойств. Объяснены все обозначения, участвующие в ответе. | Даны аккуратные определения и формулировки теорем, свойств. Не объяснены некоторые обозначения. Возможны незначительные неясности в изложении. | Определения и формулировки в целом приведены, но содержат незначительные неточности, недостаточная ясность изложения | Ответ на вопрос отсутствует или содержит определения и формулировки, содержащие значительные ошибки |

Критерии оценки по результатам промежуточной аттестации складываются из результатов работы в семестре (max 80 баллов) и оценки ответа на экзамене (max 20 баллов):

- 0-55 баллов: неудовлетворительно.
- 56-70 баллов: удовлетворительно.
- 71-85 баллов: хорошо.
- 86-100 баллов: отлично.

Особенности проведения процедуры оценивания результатов обучения инвалидов и лиц с ограниченными возможностями здоровья обозначены в рабочей программе дисциплины (модуля).

4.2. Результаты промежуточной аттестации и уровни сформированности компетенций

Уровни сформированности компетенций определяются следующим образом:

1. Высокий уровень сформированности компетенций соответствует оценке отлично:
 - предполагает формирование компетенций на высоком уровне, готовность к самостоятельной профессиональной деятельности: формируются навыки сбора и ана-



МИНОБРНАУКИ РОССИИ
Федеральное государственное бюджетное образовательное
учреждение высшего образования
«Челябинский государственный университет» (ФГБОУ ВО «ЧелГУ»)
Математический факультет
Кафедра вычислительной математики

Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю) «Эконометрическое моделирование»
по направлению подготовки
01.03.02 Прикладная математика и информатика профиль «Прикладная математика и искусственный
интеллект»
ФГБОУ ВО «ЧелГУ»

Версия документа - 1

стр. 10 из 10

Первый экземпляр _____

КОПИЯ № _____

лиза эконометрических данных, построения математических моделей, их анализа и прогнозирования.

2. Средний уровень соответствует оценке хорошо:

- предполагает формирование компетенций на более высоком уровне: формируется комплексное знание особенностей сбора и анализа эконометрических данных, особенностей построения математических моделей.
- ответы на теоретические вопросы дисциплины на уровне не ниже оценки «удовлетворительно».
- Базовый уровень соответствует оценке удовлетворительно:
- предполагает формирование компетенций на начальном уровне: знание основных этапов математического моделирования.
- студент способен отвечать на вопросы в форме закрытого теста. Количество правильных ответов – не менее 50%.

3. Низкий уровень соответствует оценке неудовлетворительно.

- фрагментарные знания;
- отказ от ответа;
- знание отдельных рекомендованных источников;
- неумение использовать научную терминологию;
- наличие грубых ошибок.