

Федеральное государственное образовательное бюджетное
учреждение высшего образования
«Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации»

Уфимский филиал Финуниверситета

ФОНД ОЦЕНОЧНЫХ СРЕДСТВ

по дисциплине «Эконометрические исследования»

Разработчик: кафедра «Математика и информатика»


Направление подготовки: 38.04.01 Экономика

Образовательная программа: все направления подготовки магистратуры

РАССМОТРЕН
На заседании кафедры
«Математика и информатика»

Разработан основе

Протокол № 11
от « 31 » июня 2022 г.

Зав. кафедрой

_____/С.А. Фархиева
Подпись

Оценочные средства для оценки сформированности компетенций

Вопрос 1. (ПКН-6, УК-7) Эконометрические исследования решают задачу:

- (1) Описать основные закономерности в экономике
- (2) Установить причинно-следственные связи между явлениями в экономике
- (3) Предсказать будущее экономических показателей
- (4) Оценить степень риска в экономике

Вопрос 2. (ПКН-6, УК-6) Оценить зависимость между качественными переменными можно с помощью...

- (1) С помощью корреляции Пирсона
- (2) С помощью коэффициента детерминации
- (3) С помощью коэффициента корреляции Спирмена
- (4) С помощью F-теста

Вопрос 3. (ПКН-6, УК-7) Для анализа качественных переменных используется...

- (1) Нормальное распределение
- (2) Распределение Стьюдента
- (3) Распределение Фишера
- (4) Распределение хи-квадрат

Вопрос 4. (ПКН-6, УК-7) Для моделирования долговременной зависимости между финансовыми временными рядами используется метод:

- (1) Вэйвлет-анализ
- (2) Анализ главных компонент
- (3) Метод скользящего среднего
- (4) Метод Монте-Карло

Вопрос 5. (ПКН-6, УК-6, УК-7) Эконометрика, это...

- (1) количественный анализ экономики
- (2) качественный анализ экономики
- (3) смешанный анализ экономики
- (4) экспериментальный анализ экономики

Вопрос 6. (ПКН-6) В регрессионном анализе для оценки взаимосвязи между переменными используется коэффициент...

- (1) коэффициент Стьюдента
- (2) коэффициент Пирсона
- (3) коэффициент Грехэма
- (4) коэффициент Джеллера

Вопрос 7. (ПКН-6, УК-7) Коэффициент корреляции может принимать значение ...

- (1) от -1 до 1

- (2) от 0 до 1
- (3) от -1 до 0
- (4) только 1

Вопрос 8. (ПKN-6) Простая линейная регрессия от множественной линейной регрессии отличается...

- (1) количеством переменных
- (2) способом построения уравнения;
- (3) методом оценки параметров
- (4) всеми указанными выше отличиями

Вопрос 9. (ПKN-6) Причиной мультиколлинеарности может быть ...

- (1) очень маленькая выборка
- (2) очень большая выборка
- (3) наличие линейных зависимостей между переменными
- (4) отсутствие линейных зависимостей между переменными

Вопрос 10. (ПKN-6) Автокорреляция ошибок, это....

- (1) наличие статистической зависимости ошибок во времени
- (2) отсутствие статистической зависимости ошибок во времени
- (3) наличие линейной зависимости между ошибками
- (4) отсутствие линейной зависимости между ошибками

Вопрос 11. (ПKN-6) Модель, в которой ожидаемое значение зависимой переменной зависит только от предшествующих значений этой же переменной:

- (1) AR-модель
- (2) MA-модель
- (3) ARMA-модель
- (4) ARIMA-модель

Вопрос 12. (ПKN-6) Метод, который позволяет оценить коэффициенты модели путем минимизации суммы квадратов остатков, это ...

- (1) Метод максимального правдоподобия
- (2) Метод наименьших квадратов
- (3) Метод Монте-Карло
- (4) Метод Байеса

Вопрос 13. (ПKN-6) Выберите верный ответ на вопрос: в чем разница между мультиколлинеарностью и гетероскедастичностью.

- (1) Мультиколлинеарность - это когда предикторы взаимодействуют между собой, а гетероскедастичность - это когда ошибки изменяют свою дисперсию в зависимости от значений предикторов.
- (2) Мультиколлинеарность - это когда ошибки изменяют свою дисперсию в зависимости от значений предикторов, а гетероскедастичность - это когда предикторы взаимодействуют между собой.

(3) Мультиколлинеарность - это когда один и тот же предиктор включен в модель несколько раз, а гетероскедастичность - это когда предикторы взаимодействуют между собой.

(4) Мультиколлинеарность - это когда один и тот же предиктор включен в модель несколько раз, а гетероскедастичность - это когда ошибки независимы и имеют постоянную дисперсию на всем протяжении значений предикторов.

Вопрос 14. (ПКН-6) Ошибка прогнозирования, это ...

(1) Разность между фактическим и прогнозируемым значениями зависимой переменной

(2) Разность между фактическим и прогнозируемым значениями одного из предикторов

(3) Разность между фактическим и прогнозируемым значениями средней ошибки

(4) Разность между фактическим и прогнозируемым значениями остатков

Вопрос 15. (ПКН-6, УК-6) Н0 гипотеза это ...

(1) Нулевая гипотеза, которая предполагает, что никакой эффект не существует

(2) Альтернативная гипотеза, которая предполагает наличие эффекта

(3) Гипотеза, которая может быть проверена доверительным интервалом

(4) Гипотеза, которая построена на предыдущих исследованиях

Вопрос 16. (ПКН-6, УК-7) МНК-оценка, это оценка методом ... квадратов.

Вопрос 17. (ПКН-6, УК-7) Регрессионный анализ, это анализ ... данных.

Вопрос 18. (ПКН-6) Для оценки параметров модели обычно используется метод максимального

Вопрос 19. (ПКН-6) Значимость параметров модели характеризует t-... .

Вопрос 20. (ПКН-6) R-квадрат это – коэффициент ...

Критерии оценивания:

Оценкой «отлично» (зачет) оценивается полное освоение компетенции по данной дисциплине – 85 и выше баллов.

Оценкой «хорошо» (зачет) оценивается усвоение компетенции, однако в ответах допускаются неточности и незначительные ошибки – от 70 до 84 баллов.

Оценка «удовлетворительно» (зачет) свидетельствует о том, что студент освоил компетенции, допускает отдельные ошибки – от 50 до 69 баллов.

Оценка «неудовлетворительно» (незачет) выставляется в том случае, если студентом компетенции не освоены и ответы содержат существенные ошибки – менее 50 баллов.

Ключ к тесту

[illegible]