

Самостійна робота з курсу «Економетрика»

1. Створити базу даних у EViews з показників, вказаних у Вашому варіанті¹ (с.3-4). Для формування бази даних скористатися інтернет-ресурсами www.bank.gov.ua, www.ukrstat.gov.ua, www.me.gov.ua, www.minfin.gov.ua.
2. Побудувати множинну лінійну регресію, де залежною змінною виступає перша з вказаних у варіанті змінних. У разі необхідності додатково використати фіктивні або трендові змінні.
3. Проаналізувати отриману регресію, перевіривши модель на адекватність, коефіцієнти на значимість. У разі необхідності змінити вигляд Вашої регресії.
4. Перевірити модель на наявність гетероскедастичності збурень та автокореляції залишків. У випадку визначення цих явищ оцінити регресію за допомогою відповідного методу.
5. Порівняти фактори за ступенем їхнього впливу на залежну змінну, використавши 2 підходи (метод нормалізованих змінних та метод коефіцієнтів еластичності).
6. Перевірити модель на стійкість, розбивши всі спостереження у відношенні 2:1.
7. Оформити результати у вигляді звіту, що містить:
 - результати оцінки всіх моделей з їх аналізом;
 - графіки всіх регресій;
 - обґрунтування вибору найкращої моделі з усіх розглянутих;
 - прогнозні значення, залежної змінної, що обраховуються на основі 1 додаткового спостереження кожної незалежної змінної;
 - файл EViews з усіма даними та розрахунками заархівувати одним zip - архівом (ім'я файлу відповідає Вашому прізвищу).
8. Електронну версію роботи слід записати на комп'ютер мережі факультету **Stan** у директорію **Upload\Econometrics_08** до задачі роботи викладачу. Надруковану частину роботи потрібно здати викладачу до **12.00 18 грудня 2008 року**. Роботи, подані після цього терміну, отримають оцінку «1».

¹ Розподіл варіантів відбудеться на лекції 23.10.2008 о 13.30.

Позначення, використані у завданнях:

Y – ВВП;

$M2$ – грошовий агрегат $M2$;

r – ставка рефінансування НБУ;

T – ставка податку на прибуток підприємств;

$T^* = \frac{\text{загальні податкові надходження}}{Y}$ – реальна податкова ставка;

i – рівень цін (рівень початку 1996 року прийняти рівним 1);

I – рівень інвестицій;

w – середня заробітна плата;

C – рівень споживання;

G – державні видатки;

cur – курс євро до гривні;

U – безробіття;

$cred$ – рівень кредитів;

dep – рівень депозитів;

$prom$ – рівень промислового виробництва;

ex – експорт;

imp – імпорт.

Варіанти

№	Залежні змінні	Незалежні змінні	Вибірка	Періодичність
1.	Y	$M2, T$	1996:1 – 2007:12	Місяці
2.	$M2$	Y, T	1996:1 – 2007:12	Місяці
3.	C	Y, T	1996:1 – 2007:12	Місяці
4.	I	Y, T, r	1996:1 – 2007:4	Квартали
5.	$cred$	$r, Y, M2$	1996:1 – 2007:12	Місяці
6.	dep	$r, Y, M2$	1996:1 – 2007:12	Місяці
7.	w	$Y, M2, T$	1996:1 – 2007:12	Місяці
8.	dep	$w, M2, r$	1996:1 – 2007:12	Місяці
9.	I	$M2, r$	1996:1 – 2007:4	Квартали
10.	I	$cur, dep, M2$	1996:1 – 2007:4	Квартали
11.	I	G, r, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
12.	$M2$	r, w, dep	1996:1 – 2007:12	Місяці
13.	$M2$	G, cur, I	1996:1 – 2007:4	Квартали
14.	cur	$M2, Y, I$	1996:1 – 2007:4	Квартали
15.	dep	$cur, M2, G$	1996:1 – 2007:12	Місяці
16.	w	$G, M2, cur$	1996:1 – 2007:12	Місяці
17.	w	$M2, i, Y$	1996:1 – 2007:12	Місяці
18.	U	r, Y, i	1996:1 – 2007:4	Квартали
19.	U	$M2, Y$	1996:1 – 2007:4	Квартали
20.	dep	U, r, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
21.	Y	$r, M2, cur$	1996:1 – 2007:12	Місяці
22.	G	$M2, w, T$	1996:1 – 2007:12	Місяці
23.	r	$M2, Y, T, cur$	1996:1 – 2007:12	Місяці
24.	dep	$M2, T, Y$	1996:1 – 2007:12	Місяці
25.	$cred$	w, T, Y	1996:1 – 2007:12	Місяці
26.	$prom$	T, Y, r	1996:1 – 2007:12	Місяці
27.	$prom$	$M2, Y, cur$	1996:1 – 2007:12	Місяці
28.	U	C, I, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
29.	i	C, T, w	1996:1 – 2007:4	Квартали
30.	ex	Y, cur	1996:1 – 2007:4	Квартали
31.	ex	$M2, T, cur$	1996:1 – 2007:4	Квартали
32.	ex	I, cur, w	1996:1 – 2007:4	Квартали
33.	imp	I, cur, w	1996:1 – 2007:4	Квартали
34.	imp	$M2, T, cur$	1996:1 – 2007:4	Квартали
35.	imp	Y, cur	1996:1 – 2007:4	Квартали
36.	imp	G, T, cur	1996:1 – 2007:4	Квартали
37.	imp	$r, G, M2$	1996:1 – 2007:4	Квартали
38.	ex	C, cur, r	1996:1 – 2007:4	Квартали
39.	ex	cur, w, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
40.	imp	w, cur, T	1996:1 – 2007:4	Квартали

№	Залежні змінні	Незалежні змінні	Вибірка	Періодичність
41.	ex	$cred, Y, w$	1996:1 – 2007:4	Квартали
42.	imp	$cred, Y, w$	1996:1 – 2007:4	Квартали
43.	ex	dep, w, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
44.	imp	dep, w, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
45.	ex	Y, T, U	1996:1 – 2007:4	Квартали
46.	U	C, ex, w	1996:1 – 2007:4	Квартали
47.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r$	1996:1 – 2007:12	Місяці
48.	C	Y, I	1996:1 – 2007:4	Квартали
49.	U	dep, r, w	1996:1 – 2007:4	Квартали
50.	$\frac{G}{i}$	U, r, T	1996:1 – 2007:4	Квартали
51.	w	dep, T, r	1996:1 – 2007:12	Місяці
52.	ΔY	$T^*, r, \Delta M2$	1996:1 – 2007:12	Місяці
53.	$\Delta M2$	$\Delta Y, T^*, r$	1996:1 – 2007:12	Місяці
54.	$\frac{G}{Y}$	$T^*, r, \frac{w}{Y}$	1996:1 – 2007:12	Місяці
55.	$\frac{w}{i}$	$T^*, r, \frac{G}{Y}$	1996:1 – 2007:12	Місяці
56.	$\frac{C}{i}$	$U, T^*, \frac{M2}{i}$	1996:1 – 2007:4	Квартали
57.	$\frac{ex}{i}$	$cur, T^*, \frac{Y}{i}$	1996:1 – 2007:4	Квартали
58.	$\frac{imp}{i}$	$cur, T^*, \frac{Y}{i}$	1996:1 – 2007:4	Квартали
59.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-1), \frac{G}{Y}(-1), \frac{M2}{i}(-1)$	1996:1 – 2007:12	Місяці
60.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur, r$	1996:1 – 2007:4	Квартали