

## Самостійна робота з курсу «Економетрика»

1. Створити базу даних у EViews з показників, вказаних у Вашому варіанті (с.3-4). Для формування бази даних скористатися інтернет-ресурсами [www.bank.gov.ua](http://www.bank.gov.ua), [www.ukrstat.gov.ua](http://www.ukrstat.gov.ua), [www.me.gov.ua](http://www.me.gov.ua), [www.minfin.gov.ua](http://www.minfin.gov.ua). Для оцінки моделей використати місячні дані, у разі їх відсутності – кварталні. Якщо частина спостережень відсутня у статистичних збірниках, то використати максимально допустимий діапазон, але не пізніше 2001 року.
2. Побудувати множинну 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. Подати економічний аналіз моделі.
4. Перевірити кінцеву 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 кінцеву модель на стійкість, розбивши всі спостереження у відношенні 2:1.
7. Зробити прогноз на перші два квартали 2009 року для залежної змінної. Порівняти отримані значення з реальними, підрахувати помилку прогнозу.
8. 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).
9. Електронну версію роботи слід записати на комп'ютер мережі факультету **Stan** у папку **Upload\Econometrics\_09** або надіслати електронною поштою на адресу [SOEI@univ.kiev.ua](mailto:SOEI@univ.kiev.ua) до задачі роботи викладачу. Надруковану частину роботи потрібно здати викладачу до **12.00 17 грудня 2009 року**. Роботи, подані після цього терміну, отримають оцінку «1».

## 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;

$prom$  – реалізація промислової продукції;

$ex$  – експорт товарів та послуг;

$imp$  – імпорт товарів та послуг.

## Варіанти

№	Прізвище студента	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
1.	Буркацька О.	$Y$	$M2, prom$	1996:1 – 2008:4
2.	Вовчук Ю.	$M2$	$Y, prom$	1996:1 – 2008:4
3.	Гаврилюк К.	$C$	$Y, prom$	1996:1 – 2008:4
4.	Дрига Є.	$I$	$Y, prom, r$	1996:1 – 2008:4
5.	Запорожець І.	$cred$	$r, Y, M2$	1996:1 – 2008:4
6.	Корнієнко Д.	$dep$	$r, Y, M2$	1996:1 – 2008:4
7.	Костюк С.	$w$	$Y, M2, prom$	1996:1 – 2008:4
8.	Лісна Т.	$dep$	$w, M2, r$	1996:1 – 2008:4
9.	Мацієвський Я.	$I$	$M2, r$	1996:1 – 2008:4
10.	Надточий К.	$I$	$cur, dep, M2$	1996:1 – 2008:4
11.	Наумкін А.	$I$	$G, r, prom$	1996:1 – 2008:4
12.	Паніна Ж.	$M2$	$r, w, dep$	1996:1 – 2008:4
13.	Пришляк О.	$M2$	$G, cur, I$	1996:1 – 2008:4
14.	Римкіна М.	$cur$	$M2, Y, I$	1996:1 – 2008:4
15.	Слепченко О.	$dep$	$cur, M2, G$	1996:1 – 2008:4
16.	Степанова К.	$w$	$G, M2, cur$	1996:1 – 2008:4
17.	Чернік І.	$w$	$M2, i, Y$	1996:1 – 2008:4
18.	Черпицький К.	$U$	$r, Y, i$	1996:1 – 2008:4
19.	Барабаш О.	$U$	$M2, Y$	1996:1 – 2008:4
20.	Веремейчиков В.	$dep$	$U, r, prom$	1996:1 – 2008:4

№	Прізвище студента	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
21.	Востріков О.	$Y$	$r, M2, cur$	1996:1 – 2008:4
22.	Головко В.	$G$	$M2, w, prom$	1996:1 – 2008:4
23.	Забіяченко Н.	$r$	$M2, Y, prom, cur$	1996:1 – 2008:4
24.	Захарчук М.	$dep$	$M2, prom, Y$	1996:1 – 2008:4
25.	Когут І.	$cred$	$w, dep, Y$	1996:1 – 2008:4
26.	Литвинчук А.	$prom$	$dep, Y, r$	1996:1 – 2008:4
27.	Люта К.	$prom$	$M2, Y, cur$	1996:1 – 2008:4
28.	Нагорна М.	$U$	$C, I, dep$	1996:1 – 2008:4
29.	Оксак А.	$i$	$C, dep, w$	1996:1 – 2008:4
30.	Померанцева К.	$ex$	$Y, cur$	1996:1 – 2008:4
31.	Пометун О.	$ex$	$M2, dep, cur$	1996:1 – 2008:4
32.	Проценко Ю.	$ex$	$I, cur, w$	1996:1 – 2008:4
33.	Рубан В.	$imp$	$I, cur, w$	1996:1 – 2008:4
34.	Савран В.	$imp$	$M2, dep, cur$	1996:1 – 2008:4
35.	Сінькевич А.	$imp$	$Y, cur$	1996:1 – 2008:4
36.	Черкун І.	$imp$	$G, dep, cur$	1996:1 – 2008:4
37.	Якубів І.	$imp$	$r, G, M2$	1996:1 – 2008:4
38.	Резерв	$ex$	$C, cur, r$	1996:1 – 2008:4
39.	Резерв	$ex$	$cur, w, dep$	1996:1 – 2008:4
40.	Резерв	$imp$	$w, cur, dep$	1996:1 – 2008:4