

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, www.ukrstat.gov.ua, www.me.gov.ua, www.minfin.gov.ua. Для оцінки моделей використати квартальні дані. Якщо частина спостережень відсутня у статистичних збірниках, то використати максимально допустимий діапазон, але початок даних – не пізніше 2003 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 2010 року для залежної змінної. Порівняти отримані значення з реальними, підрахувати помилку прогнозу.
8. Оформити результати у вигляді друкованого 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 додаткових спостережень кожної незалежної змінної.
9. Електронну версію роботи (звіт у форматі MS Word 2007 та файл EViews з усіма даними та розрахунками слід заархівувати одним zip - архівом (ім'я файлу відповідає Вашому прізвищу) та надіслати електронною поштою на адресу SOEI@univ.kiev.ua до здачі роботи викладачу. Надруковану частину роботи потрібно здати викладачу до **12.50 7 грудня 2010 року**. Роботи, подані після цього терміну, отримують оцінку «0».
10. Захист роботи відбудеться **14 та 21 грудня 2010 року**.

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.	Балюк Юлія	Y	$M2, prom$	2002:1 – 2009:4
2.	Бобов Борис	$M2$	$Y, prom$	2002:1 – 2009:4
3.	Борисюк Іван	C	$Y, prom$	2002:1 – 2009:4
4.	Власов Дмитро	I	$Y, prom, r$	2002:1 – 2009:4
5.	Востріков Олексій	$cred$	$r, Y, M2$	2002:1 – 2009:4
6.	Гришин Михайло	dep	$r, Y, M2$	2002:1 – 2009:4
7.	Демешко Ірина	w	$Y, M2, prom$	2002:1 – 2009:4
8.	Демяненко Катерина	dep	$w, M2, r$	2002:1 – 2009:4
9.	Деньга Артем	I	$M2, r$	2002:1 – 2009:4
10.	Дзямко Іван	I	$cur, dep, M2$	2002:1 – 2009:4
11.	Дубленич Юрій	I	$G, r, prom$	2002:1 – 2009:4
12.	Єрмакова Зоя	$M2$	r, w, dep	2002:1 – 2009:4
13.	Кириченко Максим	$M2$	G, cur, I	2002:1 – 2009:4
14.	Кудрявцев Ігор	cur	$M2, Y, I$	2002:1 – 2009:4
15.	Кучеренко Ганна	dep	$cur, M2, G$	2002:1 – 2009:4
16.	Малевич Марина	w	$G, M2, cur$	2002:1 – 2009:4
17.	Манітенко Дар'я	w	$M2, i, Y$	2002:1 – 2009:4
18.	Медведєв Микола	U	r, Y, i	2002:1 – 2009:4
19.	Метельова Анна	U	$M2, Y$	2002:1 – 2009:4
20.	Ноздря Михайло	dep	$U, r, prom$	2002:1 – 2009:4

№	Прізвище студента	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
21.	Олешко Владислав	Y	$r, M2, cur$	2002:1 – 2009:4
22.	Осташевський Тарас	G	$M2, w, prom$	2002:1 – 2009:4
23.	Островський Андрій	r	$M2, Y, prom, cur$	2002:1 – 2009:4
24.	Ситенко Дмитро	dep	$M2, prom, Y$	2002:1 – 2009:4
25.	Собко Іван	$cred$	w, dep, Y	2002:1 – 2009:4
26.	Соболь Дмитро	$prom$	dep, Y, r	2002:1 – 2009:4
27.	Страшенко Віталій	$prom$	$M2, Y, cur$	2002:1 – 2009:4
28.	Стрижов Артем	U	C, I, dep	2002:1 – 2009:4
29.	Тимощук Евеліна	i	C, dep, w	2002:1 – 2009:4
30.	Хавронюк Валентина	ex	Y, cur	2002:1 – 2009:4
31.	Черкун Іван	ex	$M2, dep, cur$	2002:1 – 2009:4
32.	Чорноус Богдан	ex	I, cur, w	2002:1 – 2009:4
33.	Шалахман Олег	imp	I, cur, w	2002:1 – 2009:4
34.	Резерв	imp	$M2, dep, cur$	2002:1 – 2009:4
35.	Резерв	imp	Y, cur	2002:1 – 2009:4
36.	Резерв	imp	G, dep, cur	2002:1 – 2009:4
37.	Резерв	imp	$r, G, M2$	2002:1 – 2009:4
38.	Резерв	ex	C, cur, r	2002:1 – 2009:4
39.	Резерв	ex	cur, w, dep	2002:1 – 2009:4
40.	Резерв	imp	w, cur, dep	2002:1 – 2009:4