

Самостійна робота з курсу «Економетрика»

1. Створити базу даних у EViews з показників, вказаних у Вашому варіанті (с.4-9). Номер варіанта вказаний у електронному журналі Вашої групи в розділі «Самостійна робота». 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 має бути не пізніше першого кварталу 2004 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, перевібивши модель на адекватність, коефіцієнти на значимість. Перевірити модель на наявність мультиколінеарності. Провести специфікацію моделі. У разі необхідності змінити вигляд Вашої регресії. Подати економічний аналіз моделі.
4. Порівняти фактори за ступенем їхнього впливу на залежну змінну, використавши 2 підходи (метод нормалізованих змінних та метод коефіцієнтів еластичності).
5. Перевірити кінцеву модель на стійкість, розбивши всі спостереження у відношенні 2:1.
6. Перевірити кінцеву модель на наявність гетероскедастичності збурень та автокореляції залишків. У випадку визначення цих явищ оцінити регресію за допомогою відповідного методу.
7. Зробити прогноз на перші два квартали 2011 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 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 25 листопада 2011 року**. Роботи, подані після цього терміну, отримують оцінку «0».

10. Захист роботи відбудеться під час лабораторних занять з **28 листопада до 15 грудня 2011 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

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
1.	<i>Y</i>	<i>M2, prom</i>	2002:1 – 2010:4
2.	<i>M2</i>	<i>Y, prom</i>	2002:1 – 2010:4
3.	<i>C</i>	<i>Y, prom</i>	2002:1 – 2010:4
4.	<i>I</i>	<i>Y, prom, r</i>	2002:1 – 2010:4
5.	<i>cred</i>	<i>r, Y, M2</i>	2002:1 – 2010:4
6.	<i>dep</i>	<i>r, Y, M2</i>	2002:1 – 2010:4
7.	<i>w</i>	<i>Y, M2, prom</i>	2002:1 – 2010:4
8.	<i>dep</i>	<i>w, M2, r</i>	2002:1 – 2010:4
9.	<i>I</i>	<i>M2, r</i>	2002:1 – 2010:4
10.	<i>I</i>	<i>cur, dep, M2</i>	2002:1 – 2010:4
11.	<i>I</i>	<i>G, r, prom</i>	2002:1 – 2010:4
12.	<i>M2</i>	<i>r, w, dep</i>	2002:1 – 2010:4
13.	<i>M2</i>	<i>G, cur, I</i>	2002:1 – 2010:4
14.	<i>cur</i>	<i>M2, Y, I</i>	2002:1 – 2010:4
15.	<i>dep</i>	<i>cur, M2, G</i>	2002:1 – 2010:4
16.	<i>w</i>	<i>G, M2, cur</i>	2002:1 – 2010:4
17.	<i>w</i>	<i>M2, i, Y</i>	2002:1 – 2010:4
18.	<i>U</i>	<i>r, Y, i</i>	2002:1 – 2010:4
19.	<i>U</i>	<i>M2, Y</i>	2002:1 – 2010:4
20.	<i>dep</i>	<i>U, r, prom</i>	2002:1 – 2010:4
21.	<i>Y</i>	<i>r, M2, cur</i>	2002:1 – 2010:4
22.	<i>G</i>	<i>M2, w, prom</i>	2002:1 – 2010:4
23.	<i>r</i>	<i>M2, Y, prom, cur</i>	2002:1 – 2010:4
24.	<i>dep</i>	<i>M2, prom, Y</i>	2002:1 – 2010:4
25.	<i>cred</i>	<i>w, dep, Y</i>	2002:1 – 2010:4
26.	<i>prom</i>	<i>dep, Y, r</i>	2002:1 – 2010:4
27.	<i>prom</i>	<i>M2, Y, cur</i>	2002:1 – 2010:4
28.	<i>U</i>	<i>C, I, dep</i>	2002:1 – 2010:4
29.	<i>i</i>	<i>C, dep, w</i>	2002:1 – 2010:4
30.	<i>ex</i>	<i>Y, cur</i>	2002:1 – 2010:4
31.	<i>ex</i>	<i>M2, dep, cur</i>	2002:1 – 2010:4
32.	<i>ex</i>	<i>I, cur, w</i>	2002:1 – 2010:4
33.	<i>imp</i>	<i>I, cur, w</i>	2002:1 – 2010:4
34.	<i>imp</i>	<i>M2, dep, cur</i>	2002:1 – 2010:4
35.	<i>imp</i>	<i>Y, cur</i>	2002:1 – 2010:4
36.	<i>imp</i>	<i>G, dep, cur</i>	2002:1 – 2010:4
37.	<i>imp</i>	<i>r, G, M2</i>	2002:1 – 2010:4
38.	<i>ex</i>	<i>C, cur, r</i>	2002:1 – 2010:4
39.	<i>ex</i>	<i>cur, w, dep</i>	2002:1 – 2010:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
40.	<i>imp</i>	<i>w, cur, dep</i>	2002:1 – 2010:4
41.	<i>imp</i>	<i>w, cur, T*</i>	2002:1 – 2010:4
42.	<i>ex</i>	<i>cred, Y, w</i>	2002:1 – 2010:4
43.	<i>imp</i>	<i>cred, Y, w</i>	2002:1 – 2010:4
44.	<i>ex</i>	<i>dep, w, T*</i>	2002:1 – 2010:4
45.	<i>imp</i>	<i>dep, w, T*</i>	2002:1 – 2010:4
46.	<i>ex</i>	<i>Y, T*, U</i>	2002:1 – 2010:4
47.	<i>U</i>	<i>C, ex, w</i>	2002:1 – 2010:4
48.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r$	2002:1 – 2010:4
49.	<i>C</i>	<i>Y, I</i>	2002:1 – 2010:4
50.	<i>U</i>	<i>dep, r, w</i>	2002:1 – 2010:4
51.	$\frac{G}{i}$	<i>U, r, T*</i>	2002:1 – 2010:4
52.	<i>w</i>	<i>dep, T*, r</i>	2002:1 – 2010:4
53.	ΔY	<i>T*, r, $\Delta M2$</i>	2002:1 – 2010:4
54.	$\Delta M2$	$\Delta Y, T*, r$	2002:1 – 2010:4
55.	$\frac{G}{Y}$	<i>T*, r, $\frac{w}{Y}$</i>	2002:1 – 2010:4
56.	$\frac{w}{i}$	<i>T*, r, $\frac{G}{Y}$</i>	2002:1 – 2010:4
57.	$\frac{C}{i}$	<i>U, T*, $\frac{M2}{i}$</i>	2002:1 – 2010:4
58.	$\frac{ex}{i}$	<i>cur, T*, $\frac{Y}{i}$</i>	2002:1 – 2010:4
59.	$\frac{imp}{i}$	<i>cur, T*, $\frac{Y}{i}$</i>	2002:1 – 2010:4
60.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-1), \frac{G}{Y}(-1), \frac{M2}{i}(-1)$	2002:1 – 2010:4
61.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur, r$	2002:1 – 2010:4
62.	<i>Y</i>	<i>M2(-1), prom</i>	2002:1 – 2010:4
63.	<i>M2</i>	<i>Y, prom(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
64.	<i>C</i>	<i>Y(-1), prom</i>	2002:1 – 2010:4
65.	<i>I</i>	<i>Y, prom(-1), r</i>	2002:1 – 2010:4
66.	<i>cred</i>	<i>r, Y, M2(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
67.	<i>dep</i>	<i>r, Y, M2(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
68.	<i>w</i>	<i>Y, M2, prom(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
69.	<i>dep</i>	<i>w, M2, r(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
70.	<i>I</i>	<i>M2(-1), r</i>	2002:1 – 2010:4
71.	<i>I</i>	<i>cur, dep(-1), M2</i>	2002:1 – 2010:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
72.	<i>I</i>	<i>G, r(-1), prom</i>	2002:1 – 2010:4
73.	<i>M2</i>	<i>r(-1), w, dep</i>	2002:1 – 2010:4
74.	<i>M2</i>	<i>G, cur, I(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
75.	<i>cur</i>	<i>M2, Y(-1), I</i>	2002:1 – 2010:4
76.	<i>dep</i>	<i>cur(-1), M2, G</i>	2002:1 – 2010:4
77.	<i>w</i>	<i>G, M2, cur(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
78.	<i>w</i>	<i>M2, i, Y(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
79.	<i>U</i>	<i>r, Y, i(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
80.	<i>U</i>	<i>M2, Y(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
81.	<i>dep</i>	<i>U, r(-1), prom</i>	2002:1 – 2010:4
82.	<i>Y</i>	<i>r, M2(-1), cur</i>	2002:1 – 2010:4
83.	<i>G</i>	<i>M2, w(-1), prom(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
84.	<i>r</i>	<i>M2, Y, prom, cur</i>	2002:1 – 2010:4
85.	<i>dep</i>	<i>M2, prom, Y(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
86.	<i>cred</i>	<i>w(-1), dep, Y</i>	2002:1 – 2010:4
87.	<i>prom</i>	<i>dep, Y, r(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
88.	<i>prom</i>	<i>M2, Y, cur(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
89.	<i>U</i>	<i>C(-1), I, dep</i>	2002:1 – 2010:4
90.	<i>i</i>	<i>C(-1), dep, w</i>	2002:1 – 2010:4
91.	<i>ex</i>	<i>Y, cur(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
92.	<i>ex</i>	<i>M2, dep(-1), cur</i>	2002:1 – 2010:4
93.	<i>ex</i>	<i>I, cur(-1), w</i>	2002:1 – 2010:4
94.	<i>imp</i>	<i>I, cur, w(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
95.	<i>imp</i>	<i>M2, dep, cur(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
96.	<i>imp</i>	<i>Y(-1), cur</i>	2002:1 – 2010:4
97.	<i>imp</i>	<i>G, dep, cur(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
98.	<i>imp</i>	<i>r, G(-1), M2</i>	2002:1 – 2010:4
99.	<i>ex</i>	<i>C, cur(-1), r</i>	2002:1 – 2010:4
100.	<i>ex</i>	<i>cur, w, dep(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
101.	<i>imp</i>	<i>w, cur, dep(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
102.	<i>imp</i>	<i>w, cur(-1), T*</i>	2002:1 – 2010:4
103.	<i>ex</i>	<i>cred(-1), Y, w</i>	2002:1 – 2010:4
104.	<i>imp</i>	<i>cred(-1), Y, w</i>	2002:1 – 2010:4
105.	<i>ex</i>	<i>dep, w(-1), T*</i>	2002:1 – 2010:4
106.	<i>imp</i>	<i>dep, w(-1), T*</i>	2002:1 – 2010:4
107.	<i>ex</i>	<i>Y, T*, U(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
108.	<i>U</i>	<i>C, ex, w(-1)</i>	2002:1 – 2010:4
109.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r(-1)$	2002:1 – 2010:4
110.	<i>C</i>	<i>Y, I(-1)</i>	2002:1 – 2010:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
111.	U	$dep, r(-1), w$	2002:1 – 2010:4
112.	$\frac{G}{i}$	$U, r, T^*(-1)$	2002:1 – 2010:4
113.	w	$dep, T^*, r(-1)$	2002:1 – 2010:4
114.	ΔY	$T^*, r(-1), \Delta M2$	2002:1 – 2010:4
115.	$\Delta M2$	$\Delta Y, T^*(-1), r$	2002:1 – 2010:4
116.	$\frac{G}{Y}$	$T^*, r, \frac{w}{Y}(-1)$	2002:1 – 2010:4
117.	$\frac{w}{i}$	$T^*, r, \frac{G}{Y}(-1)$	2002:1 – 2010:4
118.	$\frac{C}{i}$	$U, T^*, \frac{M2}{i}(-1)$	2002:1 – 2010:4
119.	$\frac{ex}{i}$	$cur, T^*, \frac{Y}{i}(-1)$	2002:1 – 2010:4
120.	$\frac{imp}{i}$	$cur, T^*, \frac{Y}{i}(-1)$	2002:1 – 2010:4
121.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-1), \frac{G}{Y}, \frac{M2}{i}(-1)$	2002:1 – 2010:4
122.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur, r(-1)$	2002:1 – 2010:4
123.	dep	$r, Y(-2), M2$	2002:1 – 2010:4
124.	w	$Y, M2(-2), prom$	2002:1 – 2010:4
125.	dep	$w, M2(-2), r$	2002:1 – 2010:4
126.	I	$M2, r(-2)$	2002:1 – 2010:4
127.	I	$cur(-2), dep(-2), M2$	2002:1 – 2010:4
128.	I	$G, r(-2), prom$	2002:1 – 2010:4
129.	$M2$	$r, w(-2), dep$	2002:1 – 2010:4
130.	$M2$	$G, cur(-2), I$	2002:1 – 2010:4
131.	cur	$M2, Y, I(-2)$	2002:1 – 2010:4
132.	dep	$cur, M2, G(-2)$	2002:1 – 2010:4
133.	w	$G, M2, cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
134.	w	$M2, i(-2), Y$	2002:1 – 2010:4
135.	U	$r, Y(-2), i$	2002:1 – 2010:4
136.	U	$M2(-2), Y$	2002:1 – 2010:4
137.	dep	$U, r(-2), prom$	2002:1 – 2010:4
138.	Y	$r, M2, cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
139.	G	$M2, w, prom(-2)$	2002:1 – 2010:4
140.	r	$M2, Y, prom(-2), cur$	2002:1 – 2010:4
141.	dep	$M2, prom(-2), Y$	2002:1 – 2010:4
142.	$cred$	$w(-2), dep, Y$	2002:1 – 2010:4
143.	$prom$	$dep, Y(-2), r$	2002:1 – 2010:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
144.	$prom$	$M2, Y(-2), cur$	2002:1 – 2010:4
145.	U	$C, I(-2), dep$	2002:1 – 2010:4
146.	i	$C, dep(-2), w$	2002:1 – 2010:4
147.	ex	$Y, cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
148.	ex	$M2, dep, cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
149.	ex	$I, cur, w(-2)$	2002:1 – 2010:4
150.	imp	$I(-2), cur(-2), w$	2002:1 – 2010:4
151.	imp	$M2, dep(-2), cur$	2002:1 – 2010:4
152.	imp	$Y, cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
153.	imp	$G, dep, cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
154.	imp	$r, G, M2(-2)$	2002:1 – 2010:4
155.	ex	$C, cur, r(-2)$	2002:1 – 2010:4
156.	ex	$cur, w, dep(-2)$	2002:1 – 2010:4
157.	imp	$w, cur, dep(-2)$	2002:1 – 2010:4
158.	imp	$w, cur, T^*(-2)$	2002:1 – 2010:4
159.	ex	$cred, Y, w(-2)$	2002:1 – 2010:4
160.	imp	$cred, Y, w(-2)$	2002:1 – 2010:4
161.	ex	$dep(-2), w, T^*$	2002:1 – 2010:4
162.	imp	$dep(-2), w, T^*$	2002:1 – 2010:4
163.	ex	$Y(-2), T^*, U$	2002:1 – 2010:4
164.	U	$C, ex(-2), w$	2002:1 – 2010:4
165.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r(-2)$	2002:1 – 2010:4
166.	C	$Y, I(-2)$	2002:1 – 2010:4
167.	U	$dep, r(-2), w$	2002:1 – 2010:4
168.	$\frac{G}{i}$	$U, r(-2), T^*$	2002:1 – 2010:4
169.	w	$dep, T^*(-2), r$	2002:1 – 2010:4
170.	ΔY	$T^*, r, \Delta M2(-2)$	2002:1 – 2010:4
171.	$\Delta M2$	$\Delta Y, T^*, r(-2)$	2002:1 – 2010:4
172.	$\frac{G}{Y}$	$T^*, r, \frac{w}{Y}(-2)$	2002:1 – 2010:4
173.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-2), r, \frac{G}{Y}$	2002:1 – 2010:4
174.	$\frac{C}{i}$	$U, T^*(-2), \frac{M2}{i}$	2002:1 – 2010:4
175.	$\frac{ex}{i}$	$cur, T^*(-2), \frac{Y}{i}$	2002:1 – 2010:4
176.	$\frac{imp}{i}$	$cur, T^*(-2), \frac{Y}{i}$	2002:1 – 2010:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
177.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-2), \frac{G}{Y}(-1), \frac{M2}{i}(-1)$	2002:1 – 2010:4
178.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur(-2), r(-2)$	2002:1 – 2010:4
179.	Y	$M2(-1), prom(-2)$	2002:1 – 2010:4
180.	$M2$	$Y, prom(-2)$	2002:1 – 2010:4
181.	C	$Y(-1), prom(-2)$	2002:1 – 2010:4
182.	I	$Y(-2), prom(-1), r$	2002:1 – 2010:4
183.	$cred$	$r, Y(-2), M2(-1)$	2002:1 – 2010:4
184.	dep	$r, Y(-2), M2(-1)$	2002:1 – 2010:4
185.	w	$Y, M2(-2), prom(-1)$	2002:1 – 2010:4
186.	dep	$w, M2(-2), r(-1)$	2002:1 – 2010:4
187.	I	$M2(-1), r(-2)$	2002:1 – 2010:4
188.	I	$cur, dep(-1), M2(-2)$	2002:1 – 2010:4
189.	I	$G, r(-1), prom(-2)$	2002:1 – 2010:4
190.	$M2$	$r(-1), w, dep(-2)$	2002:1 – 2010:4
191.	$M2$	$G(-2), cur, I(-1)$	2002:1 – 2010:4
192.	cur	$M2(-2), Y(-1), I$	2002:1 – 2010:4
193.	dep	$cur(-1), M2(-2), G$	2002:1 – 2010:4
194.	w	$G, M2(-2), cur(-1)$	2002:1 – 2010:4
195.	w	$M2, i(-2), Y(-1)$	2002:1 – 2010:4
196.	U	$r, Y(-2), i(-1)$	2002:1 – 2010:4
197.	U	$M2(-2), Y(-1)$	2002:1 – 2010:4
198.	dep	$U, r(-1), prom(-2)$	2002:1 – 2010:4
199.	Y	$r, M2(-1), cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
200.	G	$M2(-2), w(-1), prom(-1)$	2002:1 – 2010:4
201.	r	$M2, Y(-2), prom, cur$	2002:1 – 2010:4
202.	dep	$M2, prom(-2), Y(-1)$	2002:1 – 2010:4
203.	$cred$	$w(-1), dep, Y(-2)$	2002:1 – 2010:4
204.	$prom$	$dep, Y(-2), r(-1)$	2002:1 – 2010:4
205.	$prom$	$M2, Y(-2), cur(-1)$	2002:1 – 2010:4
206.	U	$C(-1), I(-2), dep$	2002:1 – 2010:4
207.	i	$C(-1), dep(-2), w$	2002:1 – 2010:4
208.	ex	$Y, cur(-1)$	2002:1 – 2010:4
209.	ex	$M2, dep(-1), cur(-2)$	2002:1 – 2010:4
210.	ex	$I, cur(-1), w(-2)$	2002:1 – 2010:4