

## Самостійна робота з курсу «Економетрика» – 2012

### Завдання 1

1. Створити базу даних у EViews з показників, вказаних у Вашому варіанті (с.4-12). Номер варіанта вказаний у електронному журналі Вашої групи в розділі «Самостійна робота». 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 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, перевіривши модель на адекватність, коефіцієнти на значимість. Перевірити модель на наявність мультиколінеарності. Провести специфікацію моделі. У разі необхідності змінити вигляд Вашої регресії. При потребі використати трендові та фіктивні змінні. 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 2012 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.

## Завдання 2<sup>1</sup>

9. Підготувати презентацію на задану тему (згідно з номером варіанту)<sup>2</sup>.

### Здача роботи

10. Електронну версію роботи (звіт у форматі MS Word, файл EViews з усіма даними та розрахунками, презентацію у MS PowerPoint слід заархівувати одним zip - архівом (ім'я файлу відповідає Вашому прізвищу) та надіслати електронною поштою на адресу [SOEI@univ.kiev.ua](mailto:SOEI@univ.kiev.ua) до здачи роботи викладачу<sup>3</sup>. Надруковану частину роботи потрібно здати викладачу до **12.50 23 листопада 2012 року**. Роботи, подані після цього терміну, отримують оцінку не більше 10 балів.
11. Захист роботи та презентація завдання 2 відбудеться під час лабораторних занять з **26 листопада до 21 грудня 2012 року**.

---

<sup>1</sup> Не виконується студентами спеціальності ЕП

<sup>2</sup> Розмір шрифтів у презентації **не може** бути меншим 22, а кількість слів на одному слайді – перевищувати 30. Всі формули мають бути вставлені у редакторі MathType. Останні слайди мають містити список використаних джерел. **Скріншоти роботи в EViews для завдань 71-96 – обов'язкові!**

<sup>3</sup> У полі тема слід зазначити назву спеціальності (2 літери), курс (1 цифра), прізвище студента у форматі «ОА4\_Петров»

**Позначення, використані у завданні 1:**

$Y$  – 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 завдання 1

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
1.	<i>Y</i>	<i>M2, prom</i>	2004:1 – 2011:4
2.	<i>M2</i>	<i>Y, prom</i>	2004:1 – 2011:4
3.	<i>C</i>	<i>Y, prom</i>	2004:1 – 2011:4
4.	<i>I</i>	<i>Y, prom, r</i>	2004:1 – 2011:4
5.	<i>cred</i>	<i>r, Y, M2</i>	2004:1 – 2011:4
6.	<i>dep</i>	<i>r, Y, M2</i>	2004:1 – 2011:4
7.	<i>w</i>	<i>Y, M2, prom</i>	2004:1 – 2011:4
8.	<i>dep</i>	<i>w, M2, r</i>	2004:1 – 2011:4
9.	<i>I</i>	<i>M2, r</i>	2004:1 – 2011:4
10.	<i>I</i>	<i>cur, dep, M2</i>	2004:1 – 2011:4
11.	<i>I</i>	<i>G, r, prom</i>	2004:1 – 2011:4
12.	<i>M2</i>	<i>r, w, dep</i>	2004:1 – 2011:4
13.	<i>M2</i>	<i>G, cur, I</i>	2004:1 – 2011:4
14.	<i>cur</i>	<i>M2, Y, I</i>	2004:1 – 2011:4
15.	<i>dep</i>	<i>cur, M2, G</i>	2004:1 – 2011:4
16.	<i>w</i>	<i>G, M2, cur</i>	2004:1 – 2011:4
17.	<i>w</i>	<i>M2, i, Y</i>	2004:1 – 2011:4
18.	<i>U</i>	<i>r, Y, i</i>	2004:1 – 2011:4
19.	<i>U</i>	<i>M2, Y</i>	2004:1 – 2011:4
20.	<i>dep</i>	<i>U, r, prom</i>	2004:1 – 2011:4
21.	<i>Y</i>	<i>r, M2, cur</i>	2004:1 – 2011:4
22.	<i>G</i>	<i>M2, w, prom</i>	2004:1 – 2011:4
23.	<i>r</i>	<i>M2, Y, prom, cur</i>	2004:1 – 2011:4
24.	<i>dep</i>	<i>M2, prom, Y</i>	2004:1 – 2011:4
25.	<i>cred</i>	<i>w, dep, Y</i>	2004:1 – 2011:4
26.	<i>prom</i>	<i>dep, Y, r</i>	2004:1 – 2011:4
27.	<i>prom</i>	<i>M2, Y, cur</i>	2004:1 – 2011:4
28.	<i>U</i>	<i>C, I, dep</i>	2004:1 – 2011:4
29.	<i>i</i>	<i>C, dep, w</i>	2004:1 – 2011:4
30.	<i>ex</i>	<i>Y, cur</i>	2004:1 – 2011:4
31.	<i>ex</i>	<i>M2, dep, cur</i>	2004:1 – 2011:4
32.	<i>ex</i>	<i>I, cur, w</i>	2004:1 – 2011:4
33.	<i>imp</i>	<i>I, cur, w</i>	2004:1 – 2011:4
34.	<i>imp</i>	<i>M2, dep, cur</i>	2004:1 – 2011:4
35.	<i>imp</i>	<i>Y, cur</i>	2004:1 – 2011:4
36.	<i>imp</i>	<i>G, dep, cur</i>	2004:1 – 2011:4
37.	<i>imp</i>	<i>r, G, M2</i>	2004:1 – 2011:4
38.	<i>ex</i>	<i>C, cur, r</i>	2004:1 – 2011:4
39.	<i>ex</i>	<i>cur, w, dep</i>	2004:1 – 2011:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
40.	<i>imp</i>	<i>w, cur, dep</i>	2004:1 – 2011:4
41.	<i>imp</i>	<i>w, cur, T*</i>	2004:1 – 2011:4
42.	<i>ex</i>	<i>cred, Y, w</i>	2004:1 – 2011:4
43.	<i>imp</i>	<i>cred, Y, w</i>	2004:1 – 2011:4
44.	<i>ex</i>	<i>dep, w, T*</i>	2004:1 – 2011:4
45.	<i>imp</i>	<i>dep, w, T*</i>	2004:1 – 2011:4
46.	<i>ex</i>	<i>Y, T*, U</i>	2004:1 – 2011:4
47.	<i>U</i>	<i>C, ex, w</i>	2004:1 – 2011:4
48.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r$	2004:1 – 2011:4
49.	<i>C</i>	<i>Y, I</i>	2004:1 – 2011:4
50.	<i>U</i>	<i>dep, r, w</i>	2004:1 – 2011:4
51.	$\frac{G}{i}$	<i>U, r, T*</i>	2004:1 – 2011:4
52.	<i>w</i>	<i>dep, T*, r</i>	2004:1 – 2011:4
53.	$\Delta Y$	<i>T*, r, <math>\Delta M2</math></i>	2004:1 – 2011:4
54.	$\Delta M2$	$\Delta Y, T*, r$	2004:1 – 2011:4
55.	$\frac{G}{Y}$	<i>T*, r, <math>\frac{w}{Y}</math></i>	2004:1 – 2011:4
56.	$\frac{w}{i}$	<i>T*, r, <math>\frac{G}{Y}</math></i>	2004:1 – 2011:4
57.	$\frac{C}{i}$	<i>U, T*, <math>\frac{M2}{i}</math></i>	2004:1 – 2011:4
58.	$\frac{ex}{i}$	<i>cur, T*, <math>\frac{Y}{i}</math></i>	2004:1 – 2011:4
59.	$\frac{imp}{i}$	<i>cur, T*, <math>\frac{Y}{i}</math></i>	2004:1 – 2011:4
60.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-1), \frac{G}{Y}(-1), \frac{M2}{i}(-1)$	2004:1 – 2011:4
61.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur, r$	2004:1 – 2011:4
62.	<i>Y</i>	<i>M2(-1), prom</i>	2004:1 – 2011:4
63.	<i>M2</i>	<i>Y, prom(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
64.	<i>C</i>	<i>Y(-1), prom</i>	2004:1 – 2011:4
65.	<i>I</i>	<i>Y, prom(-1), r</i>	2004:1 – 2011:4
66.	<i>cred</i>	<i>r, Y, M2(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
67.	<i>dep</i>	<i>r, Y, M2(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
68.	<i>w</i>	<i>Y, M2, prom(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
69.	<i>dep</i>	<i>w, M2, r(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
70.	<i>I</i>	<i>M2(-1), r</i>	2004:1 – 2011:4
71.	<i>I</i>	<i>cur, dep(-1), M2</i>	2004:1 – 2011:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
72.	<i>I</i>	<i>G, r(-1), prom</i>	2004:1 – 2011:4
73.	<i>M2</i>	<i>r(-1), w, dep</i>	2004:1 – 2011:4
74.	<i>M2</i>	<i>G, cur, I(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
75.	<i>cur</i>	<i>M2, Y(-1), I</i>	2004:1 – 2011:4
76.	<i>dep</i>	<i>cur(-1), M2, G</i>	2004:1 – 2011:4
77.	<i>w</i>	<i>G, M2, cur(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
78.	<i>w</i>	<i>M2, i, Y(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
79.	<i>U</i>	<i>r, Y, i(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
80.	<i>U</i>	<i>M2, Y(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
81.	<i>dep</i>	<i>U, r(-1), prom</i>	2004:1 – 2011:4
82.	<i>Y</i>	<i>r, M2(-1), cur</i>	2004:1 – 2011:4
83.	<i>G</i>	<i>M2, w(-1), prom(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
84.	<i>r</i>	<i>M2, Y, prom, cur</i>	2004:1 – 2011:4
85.	<i>dep</i>	<i>M2, prom, Y(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
86.	<i>cred</i>	<i>w(-1), dep, Y</i>	2004:1 – 2011:4
87.	<i>prom</i>	<i>dep, Y, r(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
88.	<i>prom</i>	<i>M2, Y, cur(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
89.	<i>U</i>	<i>C(-1), I, dep</i>	2004:1 – 2011:4
90.	<i>i</i>	<i>C(-1), dep, w</i>	2004:1 – 2011:4
91.	<i>ex</i>	<i>Y, cur(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
92.	<i>ex</i>	<i>M2, dep(-1), cur</i>	2004:1 – 2011:4
93.	<i>ex</i>	<i>I, cur(-1), w</i>	2004:1 – 2011:4
94.	<i>imp</i>	<i>I, cur, w(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
95.	<i>imp</i>	<i>M2, dep, cur(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
96.	<i>imp</i>	<i>Y(-1), cur</i>	2004:1 – 2011:4
97.	<i>imp</i>	<i>G, dep, cur(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
98.	<i>imp</i>	<i>r, G(-1), M2</i>	2004:1 – 2011:4
99.	<i>ex</i>	<i>C, cur(-1), r</i>	2004:1 – 2011:4
100.	<i>ex</i>	<i>cur, w, dep(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
101.	<i>imp</i>	<i>w, cur, dep(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
102.	<i>imp</i>	<i>w, cur(-1), T*</i>	2004:1 – 2011:4
103.	<i>ex</i>	<i>cred(-1), Y, w</i>	2004:1 – 2011:4
104.	<i>imp</i>	<i>cred(-1), Y, w</i>	2004:1 – 2011:4
105.	<i>ex</i>	<i>dep, w(-1), T*</i>	2004:1 – 2011:4
106.	<i>imp</i>	<i>dep, w(-1), T*</i>	2004:1 – 2011:4
107.	<i>ex</i>	<i>Y, T*, U(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
108.	<i>U</i>	<i>C, ex, w(-1)</i>	2004:1 – 2011:4
109.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r(-1)$	2004:1 – 2011:4
110.	<i>C</i>	<i>Y, I(-1)</i>	2004:1 – 2011:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
111.	$U$	$dep, r(-1), w$	2004:1 – 2011:4
112.	$\frac{G}{i}$	$U, r, T^*(-1)$	2004:1 – 2011:4
113.	$w$	$dep, T^*, r(-1)$	2004:1 – 2011:4
114.	$\Delta Y$	$T^*, r(-1), \Delta M2$	2004:1 – 2011:4
115.	$\Delta M2$	$\Delta Y, T^*(-1), r$	2004:1 – 2011:4
116.	$\frac{G}{Y}$	$T^*, r, \frac{w}{Y}(-1)$	2004:1 – 2011:4
117.	$\frac{w}{i}$	$T^*, r, \frac{G}{Y}(-1)$	2004:1 – 2011:4
118.	$\frac{C}{i}$	$U, T^*, \frac{M2}{i}(-1)$	2004:1 – 2011:4
119.	$\frac{ex}{i}$	$cur, T^*, \frac{Y}{i}(-1)$	2004:1 – 2011:4
120.	$\frac{imp}{i}$	$cur, T^*, \frac{Y}{i}(-1)$	2004:1 – 2011:4
121.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-1), \frac{G}{Y}, \frac{M2}{i}(-1)$	2004:1 – 2011:4
122.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur, r(-1)$	2004:1 – 2011:4
123.	$dep$	$r, Y(-2), M2$	2004:1 – 2011:4
124.	$w$	$Y, M2(-2), prom$	2004:1 – 2011:4
125.	$dep$	$w, M2(-2), r$	2004:1 – 2011:4
126.	$I$	$M2, r(-2)$	2004:1 – 2011:4
127.	$I$	$cur(-2), dep(-2), M2$	2004:1 – 2011:4
128.	$I$	$G, r(-2), prom$	2004:1 – 2011:4
129.	$M2$	$r, w(-2), dep$	2004:1 – 2011:4
130.	$M2$	$G, cur(-2), I$	2004:1 – 2011:4
131.	$cur$	$M2, Y, I(-2)$	2004:1 – 2011:4
132.	$dep$	$cur, M2, G(-2)$	2004:1 – 2011:4
133.	$w$	$G, M2, cur(-2)$	2004:1 – 2011:4
134.	$w$	$M2, i(-2), Y$	2004:1 – 2011:4
135.	$U$	$r, Y(-2), i$	2004:1 – 2011:4
136.	$U$	$M2(-2), Y$	2004:1 – 2011:4
137.	$dep$	$U, r(-2), prom$	2004:1 – 2011:4
138.	$Y$	$r, M2, cur(-2)$	2004:1 – 2011:4
139.	$G$	$M2, w, prom(-2)$	2004:1 – 2011:4
140.	$r$	$M2, Y, prom(-2), cur$	2004:1 – 2011:4
141.	$dep$	$M2, prom(-2), Y$	2004:1 – 2011:4
142.	$cred$	$w(-2), dep, Y$	2004:1 – 2011:4
143.	$prom$	$dep, Y(-2), r$	2004:1 – 2011:4

№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
144.	<i>prom</i>	<i>M2, Y (-2), cur</i>	2004:1 – 2011:4
145.	<i>U</i>	<i>C, I (-2), dep</i>	2004:1 – 2011:4
146.	<i>i</i>	<i>C, dep (-2), w</i>	2004:1 – 2011:4
147.	<i>ex</i>	<i>Y, cur (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
148.	<i>ex</i>	<i>M2, dep, cur (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
149.	<i>ex</i>	<i>I, cur, w (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
150.	<i>imp</i>	<i>I (-2), cur (-2), w</i>	2004:1 – 2011:4
151.	<i>imp</i>	<i>M2, dep (-2), cur</i>	2004:1 – 2011:4
152.	<i>imp</i>	<i>Y, cur (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
153.	<i>imp</i>	<i>G, dep, cur (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
154.	<i>imp</i>	<i>r, G, M2 (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
155.	<i>ex</i>	<i>C, cur, r (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
156.	<i>ex</i>	<i>cur, w, dep (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
157.	<i>imp</i>	<i>w, cur, dep (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
158.	<i>imp</i>	<i>w, cur, T* (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
159.	<i>ex</i>	<i>cred, Y, w (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
160.	<i>imp</i>	<i>cred, Y, w (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
161.	<i>ex</i>	<i>dep (-2), w, T*</i>	2004:1 – 2011:4
162.	<i>imp</i>	<i>dep (-2), w, T*</i>	2004:1 – 2011:4
163.	<i>ex</i>	<i>Y (-2), T*, U</i>	2004:1 – 2011:4
164.	<i>U</i>	<i>C, ex (-2), w</i>	2004:1 – 2011:4
165.	$\frac{M2}{i}$	$\frac{Y}{i}, r (-2)$	2004:1 – 2011:4
166.	<i>C</i>	<i>Y, I (-2)</i>	2004:1 – 2011:4
167.	<i>U</i>	<i>dep, r (-2), w</i>	2004:1 – 2011:4
168.	$\frac{G}{i}$	<i>U, r (-2), T*</i>	2004:1 – 2011:4
169.	<i>w</i>	<i>dep, T* (-2), r</i>	2004:1 – 2011:4
170.	$\Delta Y$	<i>T*, r, <math>\Delta M2 (-2)</math></i>	2004:1 – 2011:4
171.	$\Delta M2$	<i><math>\Delta Y, T*, r (-2)</math></i>	2004:1 – 2011:4
172.	$\frac{G}{Y}$	<i>T*, r, <math>\frac{w}{Y} (-2)</math></i>	2004:1 – 2011:4
173.	$\frac{w}{i}$	<i>T* (-2), r, <math>\frac{G}{Y}</math></i>	2004:1 – 2011:4
174.	$\frac{C}{i}$	<i>U, T* (-2), <math>\frac{M2}{i}</math></i>	2004:1 – 2011:4
175.	$\frac{ex}{i}$	<i>cur, T* (-2), <math>\frac{Y}{i}</math></i>	2004:1 – 2011:4
176.	$\frac{imp}{i}$	<i>cur, T* (-2), <math>\frac{Y}{i}</math></i>	2004:1 – 2011:4



№	Залежна змінна	Незалежні змінні	Вибірка
177.	$\frac{w}{i}$	$T^*(-2), \frac{G}{Y}(-1), \frac{M2}{i}(-1)$	2004:1 – 2011:4
178.	$\frac{C}{i}$	$\frac{Y}{i}, cur(-2), r(-2)$	2004:1 – 2011:4
179.	$Y$	$M2(-1), prom(-2)$	2004:1 – 2011:4
180.	$M2$	$Y, prom(-2)$	2004:1 – 2011:4
181.	$C$	$Y(-1), prom(-2)$	2004:1 – 2011:4
182.	$I$	$Y(-2), prom(-1), r$	2004:1 – 2011:4
183.	$cred$	$r, Y(-2), M2(-1)$	2004:1 – 2011:4
184.	$dep$	$r, Y(-2), M2(-1)$	2004:1 – 2011:4
185.	$w$	$Y, M2(-2), prom(-1)$	2004:1 – 2011:4
186.	$dep$	$w, M2(-2), r(-1)$	2004:1 – 2011:4
187.	$I$	$M2(-1), r(-2)$	2004:1 – 2011:4
188.	$I$	$cur, dep(-1), M2(-2)$	2004:1 – 2011:4
189.	$I$	$G, r(-1), prom(-2)$	2004:1 – 2011:4
190.	$M2$	$r(-1), w, dep(-2)$	2004:1 – 2011:4
191.	$M2$	$G(-2), cur, I(-1)$	2004:1 – 2011:4
192.	$cur$	$M2(-2), Y(-1), I$	2004:1 – 2011:4
193.	$dep$	$cur(-1), M2(-2), G$	2004:1 – 2011:4
194.	$w$	$G, M2(-2), cur(-1)$	2004:1 – 2011:4
195.	$w$	$M2, i(-2), Y(-1)$	2004:1 – 2011:4
196.	$U$	$r, Y(-2), i(-1)$	2004:1 – 2011:4
197.	$U$	$M2(-2), Y(-1)$	2004:1 – 2011:4
198.	$dep$	$U, r(-1), prom(-2)$	2004:1 – 2011:4
199.	$Y$	$r, M2(-1), cur(-2)$	2004:1 – 2011:4
200.	$G$	$M2(-2), w(-1), prom(-1)$	2004:1 – 2011:4
201.	$r$	$M2, Y(-2), prom, cur$	2004:1 – 2011:4
202.	$dep$	$M2, prom(-2), Y(-1)$	2004:1 – 2011:4
203.	$cred$	$w(-1), dep, Y(-2)$	2004:1 – 2011:4
204.	$prom$	$dep, Y(-2), r(-1)$	2004:1 – 2011:4
205.	$prom$	$M2, Y(-2), cur(-1)$	2004:1 – 2011:4
206.	$U$	$C(-1), I(-2), dep$	2004:1 – 2011:4
207.	$i$	$C(-1), dep(-2), w$	2004:1 – 2011:4
208.	$ex$	$Y, cur(-1)$	2004:1 – 2011:4
209.	$ex$	$M2, dep(-1), cur(-2)$	2004:1 – 2011:4
210.	$ex$	$I, cur(-1), w(-2)$	2004:1 – 2011:4

## Варіанти завдання 2

1. ARIMA(p,d,q)- процеси
2. VAR-моделі
3. Асимптотичні властивості МНК-оцінок
4. Безумовне та умовне прогнозування
5. Ваги для зваженого методу найменших квадратів у формі Нев'є-Веста
6. Векторна модель корекції похибок
7. Використання регресійних критеріїв для оцінювання моделей
8. Виявлення автокореляції статистика Дурбіна-Уотсона
9. Властивості залишків методу найменших квадратів
10. Властивості залишків методу найменших квадратів
11. Властивості оцінок методу найменших квадратів
12. Зважений метод найменших квадратів у випадку відомої коваріаційної матриці збурень
13. Знаходження оцінок параметрів простої лінійної методом найменших квадратів
14. Знаходження параметрів множинної лінійної регресії методом найменших квадратів
15. Ідентифікація одночасних рівнянь
16. Каузальність за Грейнджером
17. Квантильна регресія
18. Критерій Бройша-Годфрі
19. Критерії виявлення гетероскедастичності
20. Критерії одиничних коренів
21. Метод максимальної правдоподібності
22. Моделі бінарного та множинного вибору
23. Моделі з лаговими змінними
24. Моделі з нескінченною довжиною лагів
25. Моделі з нескінченною довжиною лагів і економічна теорія
26. Моделі з обмеженими залежними змінними
27. Моделі з панельними даними
28. Моделі, що зводяться до простої лінійної регресії
29. Моделі, які зводяться до моделі множинної лінійної регресії
30. Модель лінійної регресії з автокорельованими збуреннями
31. Модель лінійної регресії з гетероскедастичними збуреннями
32. Обмежене оцінювання скінченних моделей з розподіленими лагами
33. Опис множинної лінійної регресії
34. Опис простої лінійної регресії

35. Ортогоналізація для VAR-моделей
36. Оцінка систем одночасних рівнянь
37. Оцінювання моделей з нескінченною довжиною лагів
38. Оцінювання моделей з розподіленими лагами
39. Оцінювання та специфікація VAR-моделей
40. Оцінювання у випадку невідомої кореляційної матриці збурень
41. Перевірка гіпотези про наявність мультиколінеарності
42. Перевірка гіпотези про систему лінійних обмежень
43. Перевірка моделі на стійкість
44. Перевірка статистичних гіпотез у моделі множинної лінійної регресії
45. Перевірка статистичних гіпотез у моделі простої лінійної регресії
46. Поняття економетрики. Її задачі, методи досліджень. Приклади економетричних моделей
47. Поняття коінтеграції
48. Поняття часового ряду. Адитивна та мультиплікативна моделі часових рядів. Числові характеристики часових рядів. Лаговий оператор та оператор різниці
49. Порівняння факторів за ступенем їх впливу
50. Прогнозування за допомогою простої лінійної регресії
51. Прогнозування при наявності авторегресії помилок
52. Процедура покрокового відбору змінних
53. Процес «білого шуму» .  $MA(q)$ –процес. Процес авторегресії  $AR(p)$ .  $ARMA(p,q)$ –процес. Прогнозування на основі  $ARMA(p,q)$ -моделей
54. Процес авторегресії першого порядку
55. Регресія у випадку тренд-стаціонарних часових рядів
56. Рекурсивні моделі одночасних рівнянь
57. Розклад дисперсії для VAR-моделей
58. Розклад дисперсії залежної змінної коефіцієнт детермінації скоригований коефіцієнт детермінації
59. Розклад дисперсії залежної змінної. Коефіцієнт детермінації
60. Системи одночасних рівнянь
61. Специфікація моделі
62. Статистичні властивості оцінок методу найменших квадратів, Теорема Гауса-Маркова
63. Структурний вигляд системи одночасних рівнянь
64. Структурні VAR-моделі
65. Узагальнений метод найменших квадратів у випадку  $AR(1)$ -збурень
66. Узагальнений метод найменших квадратів у випадку відомої кореляційної матриці

67. Умова стаціонарності VAR-моделей
68. Фіктивні змінні
69. Фільтр Кальмана
70. Функція імпульсної реакції
71. Аналіз груп часових рядів у EViews
72. Аналіз часового ряду у EViews
73. Використання методу інструментальних змінних та методу моментів у EViews
74. Використання методу моментів у EViews
75. Імпорт та експорт даних у EViews
76. Методи програмування у EViews
77. Одновимірний аналіз часових рядів у EViews
78. Основні принципи роботи у EViews
79. Оцінка ARIMA-процесів у EViews
80. Оцінка GARCH-моделей у EViews
81. Оцінка VAR-моделей у EViews
82. Оцінка регресій у програмному режимі у EViews
83. Оцінка систем регресійних рівнянь у EViews
84. Оцінювання квантильних регресій у EViews
85. Оцінювання коінтегрованих регресій у EViews
86. Перевірка статистичних гіпотез у програмному режимі у EViews
87. Побудова графіків у EViews
88. Побудова регресій з дискретними та цензурованими вибірками у EViews
89. Різновиди МНК та їх застосування
90. Робота з базами даних у EViews
91. Робота з матрицями у EViews
92. Робота з панелями та груповими даними у EViews
93. Робота з просторовими моделями у EViews
94. Роботи з даними у EViews, створення автооновлюваних змінних, зв'язування даних
95. Тестування на коінтеграцію у EViews
96. Факторний аналіз у EViews