Контрольная работа

По э**конометрики**

**Обзор корреляционного поля**

Эти данные скорее всего можно аппроксимировать при помощи линейной регрессии вида *ŷ = а - b·x,* как самой простой.

Рассчитаем необходимые суммы и запишем их в таблице № 1:

*Таблица №1:*

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| ***i*** | ***x*** | ***y*** | ***x²*** | ***y²*** | ***x·y*** | ***ŷ*** | ***e*** | ***e²*** | ***A****(%)* |
| 1 | 2,5 | 69 | 6,25 | 4761 | 172,5 | 66,40 | 2,60 | 6,75 | 3,76 |
| 2 | 3 | 65 | 9 | 4225 | 195 | 64,85 | 0,15 | 0,02 | 0,23 |
| 3 | 3,4 | 63 | 11,56 | 3969 | 214,2 | 63,61 | -0,61 | 0,37 | 0,97 |
| 4 | 4,1 | 59 | 16,81 | 3481 | 241,9 | 61,44 | -2,44 | 5,94 | 4,13 |
| 5 | 5 | 57 | 25 | 3249 | 285 | 58,65 | -1,65 | 2,71 | 2,89 |
| 6 | 6,3 | 55 | 39,69 | 3025 | 346,5 | 54,61 | 0,39 | 0,15 | 0,70 |
| 7 | 7 | 54 | 49 | 2916 | 378 | 52,44 | 1,56 | 2,43 | 2,89 |
| **Сумма:** | 31,3 | 422 | 157,31 | 25626 | 1833,1 | 422,00 | 0,00 | 18,38 | 15,57 |
| **Среднее:** | 4,471 | 60,286 | 22,473 | 3660,857 | 261,871 | - | - | - | 2,22% |

Ковариация между *y* и *x* рассчитывается по формуле , где , , . Дисперсия и среднее квадратическое отклонение для *x* и *y* находим по формулам:

= 2,479, = 26,490, 1,575, 5,147.

 = -7,692 / 2,479 = -3,103; = 60,286 + 3,103 · 4,471 = 74,159

Получили уравнение регрессии: ŷ = 74,159 - 3,103·*х* (округлено до сотых).

Оцениваем качество полученной линейной модели:

а) TSS = 25624 - (31,3²) : 7 = 185,492; RSS = TSS - ESS = 185,429 - 18,38 = 176,051, где ESS = = 18,38 (в таблице №1); F - статистика = RSS · (n - m - 1) : ESS = 176,051 · ·5 :18,38 = 45,45.

Табличное значение на 1% уровне значимости равно 16,26 (см. таблицу распределения Фишера - Снедекора). Фактическое значение F - статистики больше табличного на 1% уровне значимости, следовательно уравнение регрессии в целом значимо и на 5% уровне значимости.

б) Средняя ошибка аппроксимации равна (ΣА)/7 = ((ΣIy-ŷI: y) · 100%) / 7 = 15,57 / 7 = =2,22%, что говорит о хорошей аппроксимации зависимости моделью (2,22% < 6%).

Вывод: модель получилась приемлемая (в смысле аппроксимации).

в) Коэффициент корреляции находим по формуле: = -0,949: сильная обратная линейная зависимость.

г) Коэффициент детерминации находим следующим образом: = 0,901 или вариация *x* определяет вариацию *y* на 90,1%.

**Проверка на соответствие условиям теоремы Гаусса - Маркова**

а) По таблице №2 рассчитаем статистику Дарбина - Уотсона:

*Таблица №2*

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *i* | *e²* | *e* | *ei-1* | *(ei-ei-1)²* | =16,050 : 18,38 = 0,8734. |
| 1 | 6,75 | 2,60 | - | - |
| 2 | 0,02 | 0,15 | 2,598 | 5,996 |
| 3 | 0,37 | -0,61 | 0,149 | 0,576 |
| 4 | 5,94 | -2,44 | -0,610 | 3,342 |
| 5 | 2,71 | -1,65 | -2,438 | 0,628 |
| 6 | 0,15 | 0,39 | -1,646 | 4,134 |
| 7 | 2,43 | 1,56 | 0,388 | 1,373 |
| Итого: | 18,38 | - | -1,559 | 16,050 |

Полученное значение попадает в область неопределённости: *DW* (0,7; 1,35). Это значит, что для прояснения вопроса относительно автокорреляции остатков необходимо дальнейшее исследование ряда остатков другими методами, в которых отсутствует зона неопределённости.

б) Воспользуемся *тестом* серий Бройша - Годфри:

*Таблица №3*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| *t* | *et* | *et-1* | *e²t-1* | *et·et-1* | *êt* | *(y-bx)²* |
| 1 | 2,598 | 0,149 | 0,022 | 0,387 | 0,074 | 6,371 |
| 2 | 0,149 | -0,610 | 0,372 | -0,091 | -0,302 | 0,204 |
| 3 | -0,610 | -2,438 | 5,944 | 1,487 | -1,208 | 0,358 |
| 4 | -2,438 | -1,646 | 2,709 | 4,013 | -0,816 | 2,632 |
| 5 | -1,646 | 0,388 | 0,151 | -0,639 | 0,192 | 3,379 |
| 6 | 0,388 | 1,559 | 2,430 | 0,605 | 0,773 | 0,148 |
| Итого: | **-1,559** | **-2,598** | **11,628** | **5,763** | -1,287 | 13,092 |

На основании полученных данных построим уравнение регрессии без свободного члена вида *ŷ=b·x.* При этом стандартная ошибка коэффициента регрессии *b*, рассчитанная по формуле:

,

, = 1,181,

что меньше значения *t* *табл. =*2,57. Это означает, что автокорреляция первого уровня отсутствует.

Однако следует отметить, что и тест Дарбина - Уотсона и тест серий Бройша - Годфри применяются только для выборок достаточно большого размера[[1]](#footnote-1), в то время как предложенная нам для анализа выборка состоит только лишь из семи значений.

в) При помощи *критерия серий* проверим случайность распределения уровней ряда остатков. С 95% вероятностью распределение ряда остатков считается случайным, если одновременно выполняются два неравенства:

1)

общее число серий должно быть *больше* двух, и 2) - максимальная длина серии должна быть *строго меньше* пяти.

Данные для расчётов получаем из таблицы № 4.

*Таблица № 4.* Критерий серий линейная модель не проходит:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| ei | ei - ei-1 | серии | Число серий = 2, Продолжительность самой длинной серииравна 3.2 = = [2.079] = 2. (не выполняется),хотя 3 < 5. Значит уровни распределены не случайно. |
| 0,149 | -2,449 | + |
| -0,610 | -0,759 | + |
| -2,438 | -1,828 | + |
| -1,646 | 0,792 | - |
| 0,388 | 2,033 | - |
| 1,559 | 1,172 | - |

г) Соответствие ряда остатков нормальному закону распределения проверяем, используем RS-критерий:

= 2,63, где .

Значение нашего RS-критерия для 7 наблюдений практически попадает в интервал [2,67 3,69], (для 10 наблюдений) хотя и этот критерий определён для выборок более 10 единиц.

д) При помощи теста ранговой корреляции Спирмена определяем отсутствие или наличие гетероскедастичности.

*Таблица № 5.*

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Ранг *Х* | *Х* | I *ei* I | Ранг *еi* | *Di* | *D²i* | Коэффициент ранговой кореляции определяется по формуле:  |
| 1 | 2,5 | 2,60 | 7 | -6 | 36 |
| 2 | 3 | 0,15 | 4 | -2 | 4 |
| 3 | 3,4 | 0,61 | 3 | 0 | 0 |
| 4 | 4,1 | 2,44 | 1 | 3 | 9 |
| 5 | 5 | 1,65 | 2 | 3 | 9 |
| 6 | 6,3 | 0,39 | 5 | 1 | 1 |
| 7 | 7 | 1,56 | 6 | 1 | 1 |

Так как абсолютное значение статистики коэффициента ранговой корелляции =0,175 оказалась значительно меньше табличного значения , то гетероскедастичность отсутствует.

Вывод: линейная модель не соответствует всем предпосылкам регрессионного анализа (условиям теоремы Гаусса-Маркова) и, хотя она пригодна для прогнозирования, но возникает вопрос о её значимости.

**Доверительные интервалы для параметра *b* регрессии**

Стандартные ошибки для параметров регрессии находим по формулам:

= 0,46,

= 2,18.

Проверим на статистическую значимость коэффициент *b* модели, для чего рассчитаем *t*-статистику по формуле . Полученная *t*-статистика равна -6,742, что по модулю больше табличного значения *t =* 2,57. Экономически этот параметр интерпретируется так: при изменении дохода потребителей на одну единицу объёмы продаж изменятся на -3,103 ед.

Проверим на статистическую значимость коэффициент *a* модели, для чего рассчитаем *t*-статистику по формуле . Полученная *t*-статистика равна 33,992, что больше табличного значения *t =* 2,57. Доверительный интервал параметра *b* определяем по формуле:

;

s = = 1,917,

Доверительный интервал параметра *b* составляет ; или ( *tтабл.* = 2.57, Δ = 2,57 · 0,4602 = 1,1827).

Проведённый анализ коэффициентов регрессии говорит о том, что параметры регрессии значимы, кроме того и уравнение регрессии в целом значимо на 1% уровне значимости (cм. выше). Это позволяет использовать построенную нами модель для получения прогнозов.

**Точечный и интервальный прогнозы**

Вначале находим точечный прогноз для значения *х*, на 25% превышающего среднее значение = 4,47 ( т.е. при = 5,589), . Тогда стандартная ошибка прогноза составит:

,

*tтабл.* = 2.57, Δ = 2,57 · 2,18 = 5,604.

Интервальный прогноз для точечного прогноза при = 5,589 () составит: или .

1. Кристофер Доугерти. Введение в эконометрику. М.: Инфра М, 2001. С. 238. [↑](#footnote-ref-1)