

Практичне заняття 4

Розроблення економетричних моделей з лаговим змінними та моделей авторегресії

Динамічний модел з розподіленням лагом.

Завантажуємо ППП Statgraphics та відкриваємо файл даних.

Необхідно сформулювати лагові змінні. Підсвітити тобто виділити курсором нову колонку (нову змінну) та включити **Generate Data**, занести в поле **Expression** функцію **LAG (x3,1)** – це означає, що ми ідентифікуємо змінну x3 як лагову з лагом = 1. І таким чином перетворюємо всі потрібні змінні, що потрібно в задачі. Далі колонку слід перейменувати та прожовжити обчислення як в множинній регресії.

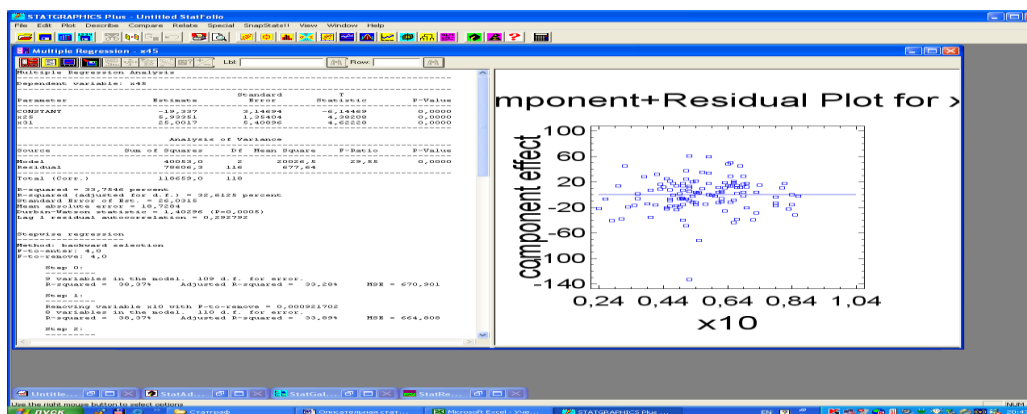
Відкриваємо **Relate** → **Multiple Regression** (множинна регресія).

Нижче зображено головне меню та процедура Relate:



File **Edit** **Plot** **Describe** **Compare** **Relate** **Special** **SnapStat!!** **View** **Window** **Help**

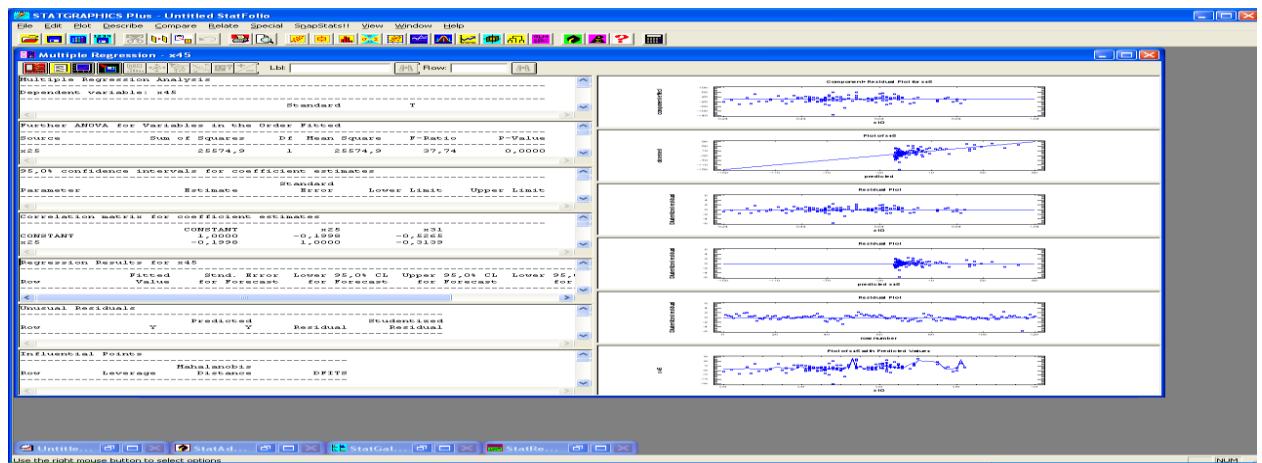
Після вибору процедури появляється її вікно вводу:

Y заносимо в поле **Depended Variable** (залежна змінна), а x3 та її лагові змінні в полі **Independend Variable** (незалежна змінна).



Виконуємо процедуру з послідовним виключенням змінних. Виберемо **Analysis Options** в контекстному меню. Встановимо переключатель **Fit** в стан **Backward Selection** та знімемо прапорець **Constant in Model**. Решта елементів управління залишимо без змінення. Отримаємо нове зведення результатів роботи процедури.

Опціями  (Tabular Options) и  (Graphical Options) можна замовити інші документи, а також можна замовити всі (All).



Всі замовлені документи та графіки можна записати у вікно StatReporter (з меню "правого клацання") і потім зберегти в текстовому файлі rtf-файле, який потім можна прочитати та відредагувати за допомогою Microsoft Word.