Министерство науки и высшего образования

Российской Федерации

Федеральное Государственное

Автономное Образовательное Учреждение

Высшего Образования

Национальный ядерный университет «МИФИ»

Кафедра: «Финансовый мониторинг»

Отчет по Лабораторной работе №4:

Студент Монастырский М. О.

Группа С21-703

Проверила: Домашова Д. В.

Оглавление

[Введение 3](#_Toc163070565)

[Постановка задачи 4](#_Toc163070566)

[МНК-оценки коэффициентов 5](#_Toc163070567)

[**Определение наличия автокорреляции** 7](#_Toc163070568)

[Построение обобщенной линейной модели множественной регрессии 8](#_Toc163070569)

[Вывод 13](#_Toc163070570)

[**Приложение А** 15](#_Toc163070571)

# Введение

О линейных регрессионных моделях с переменной структурой будем говорить в тех случаях, когда на результативную переменную помимо отобранных и измеренных объясняющих признаков оказывает существенное воздействие меняющиеся (одновременно с предопределенными переменными во времени и/или в пространстве) некоторые качественные факторы, что может вести к скачкообразным изменениям коэффициентов линейной регрессии.

Очевидна идея, связанная с разбиением исходных статистических данных на качественно-однородные группы и последующей оценкой функции регрессии в каждой из таких групп. Но такой подход либо ведет к снижению статистической надежности результатов, либо невозможен, ввиду малого объема выборки, хотя бы в одной из регрессионно-однородных подвыборок.

Выход заключается в введение фиктивных переменных (“манекенов”), однако, следует обоснованно подходить к их введению, поскольку каждая новая переменная ведет к уменьшению степеней свободы и снижению надежности выводов. Приобретение навыков построения и анализа эконометрических моделей по регрессионно-неоднородным данным является целью предлагаемой работы.

# Постановка задачи

По данным:

|  |  |
| --- | --- |
| **Наименование показателя** | **Обозначение** |
| Административный округ Москвы | X1 |
| Площадь жилой (кв.м) | X2 |
| Общая площадь (кв.м) | X4 |
| Число комнат (/2/3) | X5 |
| Количество этажей в доме | X9 |
| Этаж квартиры (первый/промежуточный/последний) | X10 |
| Тип дома (кирпичный/монолитный/панельный/блочный/кирпично-монолитный/сталинский) | X12 |
| Вид из окна (во двор/на улицу/во двор и на улицу) | X19 |
| Цена квартиры (тыс. руб.) | Y |
|  |  |
|  |  |

1. Выдвинуть и обосновать предположение о сопутствующих качественных факторах, числе уровней каждого, указать число фиктивных переменных и охарактеризовать каждую из них.
2. Записать линейную модель регрессии с переменной структурой и её матрицу “объект - свойства”.
3. Исследовать имеющиеся статистические данные на неоднородность с помощью критерия Чоу.
4. Оценить параметры регрессионной модели с переменной структурой и провести её анализ.

# Порядок выполнения

Построим линейную регрессионную модель для нашей выборки, используя в качестве объясняющих признаков только количественные переменные (X2, X4, Х9):

Multiple Regression Results

Dependent: Y Multiple R = ,79188376 F = 294,2694

R?= ,62707990 df = 3,525

No. of cases: 529 adjusted R?= ,62494892 p = 0,000000

Standard error of estimate:28769,357570

Intercept: -42787,39323 Std.Error: 3276,318 t( 525) = -13,06 p = 0,0000

X2 b\*=,226 X4 b\*=,588 X9 b\*=-,05

(significant b\* are highlighted in red)

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| N=529 | Regression Summary for Dependent Variable: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) R= ,79188376 R?= ,62707990 Adjusted R?= ,62494892 F(3,525)=294,27 p | | | | | |
| |  | | --- | | b\* | | |  | | --- | | Std.Err. of b\* | | |  | | --- | | b | | |  | | --- | | Std.Err. of b | | |  | | --- | | t(525) | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Intercept | |  |  | -42787,4 | 3276,318 | -13,0596 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X2 | | 0,226314 | 0,058995 | 488,3 | 127,300 | 3,8362 | 0,000140 |
| |  | | --- | | X4 | | 0,587822 | 0,058802 | 817,8 | 81,809 | 9,9966 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X9 | | -0,046506 | 0,026915 | -159,6 | 92,380 | -1,7279 | 0,084593 |



P= 0.00 < 0.05

Модель значима

Поскольку можно предположить нормальный характер распределения регрессионных остатков, то на основании отчета делаем выводы:

- модель значима;

- значимое влияние на результативный признак – цена квартиры, оказывают объясняющие переменные – общая площадь квартиры (Х4), жилая площадь квартиры (Х2)

- оценка уравнения регрессии:

На результативный признак могу также влиять качественные переменные , ,. Прежде чем включить их в модель, проверим выборочную совокупность на однородность с помощью критерия Чоу.

Проверим сначала по переменной административный округ Москвы.

Проверяется с помощью статистики:

# Критерий Чоу

В условиях справедливости нулевой гипотезы эта статистика распределена по закону Фишера – Снедекора с и

1. Разбиваем выборку на 6 однородных группы. Построим уравнение по объединенной выборки и получим:

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 7,306791E+11 | 3 | 2,435597E+11 | 294,2694 | 0,00 |
| |  | | --- | | Residual | | 4,345299E+11 | 525 | 8,276759E+08 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 1,165209E+12 |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Include condition: X1 = "южный" | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 4,977996E+09 | 3 | 1,659332E+09 | 67,31178 | 0,000000 |
| |  | | --- | | Residual | | 4,166093E+09 | 169 | 2,465144E+07 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 9,144089E+09 |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Exclude condition: X1 = "южный" | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 6,573540E+11 | 3 | 2,191180E+11 | 199,2668 | 0,00 |
| |  | | --- | | Residual | | 3,870666E+11 | 352 | 1,099621E+09 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 1,044421E+12 |  |  |  |  |

=5,31E-05

Расч = F(4;521) =2,3289

Выборки неоднородны

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Include condition: X1 = "северо-восточный" | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 8,756630E+09 | 3 | 2,918877E+09 | 68,50909 | 0,000000 |
| |  | | --- | | Residual | | 7,285572E+09 | 171 | 4,260568E+07 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 1,604220E+10 |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Exclude condition: X1 = "северо-восточный" | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 6,666043E+11 | 3 | 2,222014E+11 | 203,4358 | 0,00 |
| |  | | --- | | Residual | | 3,822853E+11 | 350 | 1,092244E+09 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 1,048890E+12 |  |  |  |  |

5,54E-05 < 2,389045 выборки неоднородны

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Include condition: X1 = "центральный" | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 4,155120E+11 | 3 | 1,385040E+11 | 79,32048 | 0,000000 |
| |  | | --- | | Residual | | 3,090653E+11 | 177 | 1,746132E+09 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 7,245773E+11 |  |  |  |  |

0,00017 < 2,389045 Выборки неоднородны

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Exclude condition: X1 = "центральный" | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 1,335026E+10 | 3 | 4,450085E+09 | 127,8497 | 0,00 |
| |  | | --- | | Residual | | 1,197367E+10 | 344 | 3,480717E+07 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 2,532392E+10 |  |  |  |  |

1. Разбиваем выборку на 2 однородных группы для оценки критерия ЧОУ по переменной X5

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Include condition: X5=2 | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 1,109541E+11 | 3 | 3,698469E+10 | 70,52105 | 0,000000 |
| |  | | --- | | Residual | | 1,311123E+11 | 250 | 5,244490E+08 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 2,420663E+11 |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| Effect | Analysis of Variance; DV: Y (Sheet1 in Лаб 4 данные.stw) Exclude condition: X5=2 | | | | |
| |  | | --- | | Sums of Squares | | |  | | --- | | df | | |  | | --- | | Mean Squares | | |  | | --- | | F | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Regress. | | 6,046567E+11 | 3 | 2,015522E+11 | 225,7720 | 0,00 |
| |  | | --- | | Residual | | 2,419284E+11 | 271 | 8,927245E+08 |  |  |
| |  | | --- | | Total | | 8,465851E+11 |  |  |  |  |

7,91E-05 < 2,389045 Значения неоднородны

# Введение фиктивных переменных

|  |  |
| --- | --- |
| **Наименование показателя** | **Обозначение** |
| Административный округ Москвы | X1 |
| Площадь жилой (кв.м) | X2 |
| Общая площадь (кв.м) | X4 |
| Число комнат (2/3) | X5 |
| Количество этажей в доме | X9 |
| Этаж квартиры (первый/промежуточный/последний) | X10 |
| Тип дома (кирпичный/монолитный/панельный/блочный/кирпично-монолитный/сталинский) | X12 |
| Вид из окна (во двор/на улицу/во двор и на улицу) | X19 |
| Цена квартиры (тыс. руб.) | Y |

X1имеет 3 градации, вводим 2 фиктивные переменные (Центральный-базовая):

X10 имеет 3 градации, вводим 2 фиктивные переменные (первый-базовая):

X5 имеет 2 градации, вводим 1 фиктивные переменные (первый-двухомнатная):

X19 имеет 3 градации, вводим 2 фиктивные переменные (во двор-базовая):

X12 имеет 6 градаций, вводим 5 фиктивных переменных (кирпичный-базовая):

# Построение модели с фиктивными переменными

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| N=529 | Regression Summary for Dependent Variable: Y (Sheet1 in фиктивные) R= ,84354164 R?= ,71156249 Adjusted R?= ,70312865 F(15,513)=84,370 p | | | | | |
| |  | | --- | | b\* | | |  | | --- | | Std.Err. of b\* | | |  | | --- | | b | | |  | | --- | | Std.Err. of b | | |  | | --- | | t(513) | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Intercept | |  |  | -10506,1 | 6406,08 | -1,64001 | 0,101615 |
| |  | | --- | | X1\_1 | | -0,277318 | 0,034927 | -27743,4 | 3494,17 | -7,93992 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X1\_2 | | -0,277262 | 0,034343 | -27656,6 | 3425,73 | -8,07320 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X2 | | 0,268090 | 0,056822 | 578,5 | 122,61 | 4,71809 | 0,000003 |
| |  | | --- | | X4 | | 0,457929 | 0,058730 | 637,1 | 81,71 | 7,79717 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X5\_1 | | -0,119610 | 0,030628 | -11236,1 | 2877,18 | -3,90525 | 0,000107 |
| |  | | --- | | X10\_1 | | -0,052112 | 0,042815 | -6067,5 | 4985,07 | -1,21714 | 0,224109 |
| |  | | --- | | x10\_2 | | -0,039623 | 0,042687 | -5244,9 | 5650,57 | -0,92821 | 0,353733 |
| |  | | --- | | X12\_1 | | 0,153965 | 0,036851 | 15449,4 | 3697,78 | 4,17801 | 0,000035 |
| |  | | --- | | X12\_2 | | 0,090861 | 0,035824 | 9189,6 | 3623,21 | 2,53632 | 0,011498 |
| |  | | --- | | X12\_3 | | 0,032137 | 0,027574 | 6150,2 | 5276,97 | 1,16547 | 0,244368 |
| |  | | --- | | X12\_4 | | 0,066035 | 0,029384 | 10998,9 | 4894,21 | 2,24733 | 0,025043 |
| |  | | --- | | X12\_5 | | -0,008792 | 0,024021 | -6723,4 | 18369,46 | -0,36601 | 0,714509 |
| |  | | --- | | X19\_2 | | 0,023580 | 0,026959 | 2338,9 | 2674,03 | 0,87469 | 0,382152 |
| |  | | --- | | X19\_1 | | 0,027829 | 0,027554 | 3147,0 | 3115,83 | 1,01000 | 0,312973 |
| |  | | --- | | X9 | | -0,118049 | 0,027638 | -405,2 | 94,86 | -4,27127 | 0,000023 |

После исключения мультиколлинеарности методом включения переменных получаем

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| N=529 | Regression Summary for Dependent Variable: Y (Sheet1 in фиктивные) R= ,84209304 R?= ,70912069 Adjusted R?= ,70407654 F(9,519)=140,58 p | | | | | |
| |  | | --- | | b\* | | |  | | --- | | Std.Err. of b\* | | |  | | --- | | b | | |  | | --- | | Std.Err. of b | | |  | | --- | | t(519) | | |  | | --- | | p-value | |
| |  | | --- | | Intercept | |  |  | -13716,3 | 4494,937 | -3,05150 | 0,002394 |
| |  | | --- | | X4 | | 0,455994 | 0,057993 | 634,4 | 80,683 | 7,86284 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X5\_1 | | -0,119291 | 0,030310 | -11206,1 | 2847,294 | -3,93570 | 0,000094 |
| |  | | --- | | X2 | | 0,272093 | 0,056283 | 587,1 | 121,448 | 4,83438 | 0,000002 |
| |  | | --- | | X1\_2 | | -0,269451 | 0,033221 | -26877,5 | 3313,762 | -8,11087 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X1\_1 | | -0,268015 | 0,033273 | -26812,7 | 3328,657 | -8,05512 | 0,000000 |
| |  | | --- | | X9 | | -0,114119 | 0,026324 | -391,7 | 90,351 | -4,33523 | 0,000017 |
| |  | | --- | | X12\_1 | | 0,134203 | 0,033979 | 13466,4 | 3409,548 | 3,94961 | 0,000089 |
| |  | | --- | | X12\_2 | | 0,068408 | 0,031714 | 6918,8 | 3207,552 | 2,15704 | 0,031461 |
| |  | | --- | | X12\_4 | | 0,055374 | 0,027979 | 9223,2 | 4660,246 | 1,97912 | 0,048330 |