

ĐỀ THI MÔN KINH TẾ LƯỢNG

Thời gian : 90 phút

Câu 1.

Số liệu về lợi nhuận (Y :tỷ VNĐ) và doanh thu (X:tỷ VNĐ) của một số doanh nghiệp thuộc ngành may mặc ở TPHCM năm 2004 như sau

Y (tỷ VNĐ)	8	9	11	14	20
X(tỷ VNĐ)	100	105	110	115	120

- (2 điểm) Ước lượng hàm hồi quy tuyến tính $Y_i = \beta_1 + \beta_2 X_i + U_i$ và nêu ý nghĩa kinh tế của các hệ số hồi quy.
- (2 điểm) Tính hệ số xác định của mô hình. Kiểm định và đánh giá sự phù hợp của mô hình với độ tin cậy 95%
- (2 điểm) Kiểm định giả thiết $H_0 : \beta_2 = 0$; $H_1 : \beta_2 \neq 0$ với mức ý nghĩa 5% , từ đó nhận xét xem doanh thu có thực sự ảnh hưởng đến lợi nhuận hay không ?

Câu 2.

Kết quả hồi quy giữa biến Y và biến X_2 , X_3 bằng Eviews như sau :

Dependent Variable: Y

Method: Least Squares

Date: 12/02/08 Time: 22:15

Sample: 1 18

Included observations: 18

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	106.0004	43.99031	2.409631	0.0293
X2	0.335281	0.068304	4.908652	0.0002
X3	-2.453795	0.950112	-2.582639	0.0208
R-squared	0.979381	Mean dependent var	183.6444	
Adjusted R-squared	0.976632	S.D. dependent var	88.94652	
S.E. of regression	13.59697	Akaike info criterion	8.208582	
Sum squared resid	2773.162	Schwarz criterion	8.356978	
Log likelihood	-70.87724	F-statistic	356.2415	
Durbin-Watson stat	0.771214	Prob(F-statistic)	0.000000	

- (1 điểm)Viết hàm hồi quy tuyến tính của Y theo biến X_2 và X_3
- (1 điểm)Biến X_2 và X_3 có thực sự ảnh hưởng đến biến Y hay không ? Vì sao ?
- (1 điểm)Bằng kiểm định Durbin-Watson, kiểm tra xem mô hình có xảy ra hiện tượng tự tương quan bậc nhất hay không ?

Câu 3. (1 điểm)

Hãy nêu những khó khăn của bạn khi làm bài tập nhóm . Bạn cũng như nhóm của bạn đã giải quyết khó khăn này như thế nào ?

Chú ý : Sinh viên không được sử dụng tài liệu và được sử dụng bảng số thống kê