

АНОТАЦІЯ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ ЕКОНОМЕТРИКА

Цикл: загальної підготовки для всіх спеціальностей факультету.

Статус: вибіркова навчальна дисципліна.

Навчальний рік: 2022-2023 н.р., III семестр.

Метою вивчення дисципліни є побудова економетричних моделей, які кількісно описують взаємозв'язки між економічними показниками.

Основними завданнями вивчення навчальної дисципліни є:

- 1) навчити будувати економетричні моделі та аналізувати їх якість;
- 2) навчити застосовувати програмні засоби для регресійного аналізу;
- 3) надати навички використання економетричних моделей в економічних дослідженнях.

Знання та вміння, що формуються під час вивчення дисципліни.

Після вивчення дисципліни студент повинен:

знати: сутність економетричного моделювання та його етапи; методи оцінювання параметрів парної лінійної регресії; методи оцінювання достовірності парної лінійної регресії та її параметрів; методи оцінювання прогнозних властивостей парної лінійної регресії; методи лінеаризації нелінійних функцій, знаходження їх параметрів; методи оцінювання параметрів багатофакторної лінійної регресії;

вміти: ідентифікувати змінні парної лінійної регресії; специфікувати модель парної лінійної регресії; оцінювати параметри парної лінійної регресії; перевіряти достовірність парної лінійної регресії та її параметрів; виконувати точковий та інтервальний прогнози за моделлю парної лінійної регресії; зводити нелінійні функції до лінійних; ідентифікувати змінні багатофакторної лінійної регресії; специфікувати модель багатофакторної лінійної регресії; оцінювати параметри багатофакторної лінійної регресії; перевіряти достовірність багатофакторної лінійної регресії та її параметрів.

Зміст дисципліни:

Тема 1. Поняття, предмет, методи і задачі економетрики.

Тема 2. Базові поняття теорії ймовірностей та статистики.

Тема 3. Загальна лінійна економетрична модель.

Тема 4. Мультиколінеарність.

Тема 5. Автокореляція.

Тема 6. Гетероскедастичність.

Тема 7. Нелінійні моделі.

Тема 8. Системи одночасних рівнянь.

Тема 9. Фіктивні змінні в регресійних моделях.

Тема 10. Динамічні моделі.

Викладацький склад:

Лектор: к.е.н., доцент Долгих Я.В.

Тривалість: 5 кредитів ECTS, 15 тижнів, 5 годин на тиждень.

Оцінювання: поточне оцінювання – 2 модульні контролю, підсумковий контроль – залік.