

ЕКОНОМЕТРИЧНИЙ АНАЛІЗ

Тип	дисципліна загальної підготовки - фундаментальна
Код	К-11
Семестр	2
Загальна кількість кредитів/годин	3 кр./90 год
Форми контролю	залік
Викладач	Нескородева Т. В.
Необхідні обов'язкові попередні та супутні навчальні дисципліни	«Вища математика», «Теорія ймовірностей», «Економетрія», К-11 Економетричний аналіз
Місце у структурно-логічній схемі	викладається на першому році навчання
Форми навчання	Лекції, лабораторні роботи, самостійна робота, модульний контроль
Критерії оцінювання	Поточний контроль - 100 б.
Мова викладання	українська

ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Основні завдання і етапи економетричного аналізу. Класифікація методів економетричного аналізу. Комп'ютерні програми в практиці економетричних досліджень. Порівняльний аналіз комп'ютерних програм. Вибір програм для практичної роботи. Бази даних для макроекономічного і мікроекономічного аналізу. Економетричний аналіз на основі моделей парних регресій та перевірки статистичних гіпотез. Економетричне моделювання з використанням індикативних змінних. Моделі дискретного вибору. Моделі бінарного вибору. Ідентифікація моделей типу *Logit* і *Probit*. Специфікація та оцінювання моделі *Tobit*. Оцінювання та статистичні висновки у моделях бінарного вибору. Переваги та обмеження спеціальних форм моделей. Моделювання розвитку процесу на різних стадіях (початкова стадія розвитку, стадія стабільного росту, стадія насичення) на основі виділення тренду за допомогою відповідних функцій. Згладжування часових рядів. Подвійне і потрійне експоненціальне згладжування Брауна. Адаптивне згладжування. Несезонна, адитивна та мультиплікативні моделі Холта-Вінтерса. Фільтр Ходріка-Прескотта. Моделювання економічних процесів з сезонним коливанням. Фільтрація компонент тренд-сезонних коливань. Розробка комплексу моделей систем одночасних регресійних рівнянь управління розвитком промислового підприємства з урахуванням різного ступеню адаптації до трансформаційних ефектів національної економіки. Моделі з панельними даними. Фіксовані ефекти. Випадкові ефекти. Тест Хаусмана для порівняння фіксованих або випадкових ефектів.

Програмні результати навчання визначені в освітній програмі:

Здійснювати інформаційну підтримку управлінських рішень (ПРН-4).

Визначати поточний і майбутній фінансовий стан суб'єкта господарювання, його фінансові результати, грошові потоки, використовуючи сучасні техніки аналізу (ПРН-8).

Ідентифікувати та здійснювати аналіз внутрішніх та зовнішніх чинників, що мають вплив на стратегію діяльності суб'єктів господарювання та визначають їх економічну поведінку (ПРН-9).

Аналізувати фінансові та нефінансові дані для формування релевантної інформації в цілях прийняття управлінських рішень **(ПРН-10)**.

Застосовувати наукові методи досліджень у сфері обліку, аудиту, аналізу, контролю та оподаткування та імплементувати їх у професійну діяльність та господарську практику **(ПРН-15)**.