

ЕКОНОМЕТРИКА

Тип	Дисципліна загальної підготовки - фундаментальна
Код	К-29
Семестр	5
Загальна кількість кредитів/годин	4/120
Форми контролю	Екзамен
Викладач	Христіановський В. В.
Необхідні обов'язкові попередні та супутні навчальні дисципліни	Вища математика, Теорія ймовірностей та математична статистика
Місце у структурно-логічній схемі	К-29 Економетрика викладається на третьому році навчання
Форми навчання	Лекції, лабораторні роботи, самостійна робота
Критерії оцінювання	Поточний контроль - 60 б., Підсумковий контроль (екзамен) – 40 б.
Мова викладання	українська

ЗМІСТ НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

Вступ. Природа економетрії. Приклади використання економетричних методів при вирішенні економічних задач. Загальні поняття економетрії. Основні аспекти економетричного моделювання. Приклад постановки задачі побудови економетричної моделі (ціна на автомобіль). Кореляційний зв'язок між економічними змінними, типи зв'язків. Вибірki із генеральної сукупності. Основні статистики, що характеризують вибірки. Лінійна модель парної регресії в регресійному аналізі. Метод найменших квадратів, як основний при розрахунку регресійної моделі. Оцінка якості рівняння регресії, коефіцієнт детермінації, коефіцієнт множинної кореляції, помилка апроксимації. Перевірка значущості рівняння регресії в цілому і окремих її параметрів. Оцінка параметрів моделі множинної регресії. Поліноми різних ступенів, рівностороння гіпербола, степенева залежність, гіперболічна залежність, квадратична залежність. Визначення параметрів моделі множинної регресії. Бажане співвідношення між числом оцінюваних параметрів і числом спостережень в вибірці. Перевірка виконання передумов методу найменших квадратів. Умови Гаусса-Маркова. Методи усунення мультиколінеарності. Статистичний алгоритм Фаррара-Глобера. Перевірка лінійного рівняння на гомо і гетероскедастичність тест Глейсера. Усунення гетероскедастичності. Узагальнений метод найменших квадратів для розрахунку ефективних оцінок регресивної моделі. Теорема Айткена. Автокореляція в регресійних моделях. Метод рядів, метод Дарбіна – Уотсона. Способи усунення автокореляції. Приклад перевірки наявності автокореляції залишків за допомогою критерія Дарбіна-Уотсона. Регресивні рівняння зі змінною структурою. Фіктивні змінні. Системи одночасних регресійних рівнянь. Проблема ідентифікації моделі. Необхідна і достатня умови

ідентифікації. Приклади на перевірку ідентифікації рівнянь структурної моделі пропозиції. Виробничі функції. Функція Кобба-Дугласа і її використання на практиці. Часові ряди. Основні поняття та визначення. Згладжування часового ряду. Аналітичні методи, методи механічного згладжування, метод простої і зваженої ковзкої середньої. Метод експотенціального згладжування. Приклад.

Аналіз динамічних рядів за допомогою автокореляційної функції. Розрахунок основних показників динаміки економічних процесів. Приклади.

Побудова моделей часових рядів. Моделі кривих росту, їх розрахунок. Адаптивні моделі прогнозування, метод Брауна, 1,2 алгоритми. Оцінка якості моделі. Оцінка точності моделі. Побудова точкових і інтервальних прогнозів. Моделювання економічних процесів з сезонним коливанням. Фільтрація компонент тренд-сезонних коливань. Модель авторегресії. Моделі стаціонарних та нестаціонарних часових рядів.

Програмні результати навчання визначені в освітній програмі:

Застосовувати спеціалізовані інформаційні системи і комп'ютерні технології у професійній сфері (ПРН-11).

Володіти базовими знаннями фундаментальних розділів математики в обсязі, необхідному для застосування економіко-математичних методів у обраній професії (ПРН-13).

Демонструвати навички володіння загальнонауковими та спеціальними методами дослідження економічних явищ і процесів на підприємстві (ПРН-14).