

Навчальна дисципліна: ЕКОНОМЕТРИКА

Статус: нормативна

Курс: 3

Семестр: 5

Кількість залікових кредитів ECTS – 3,0

Опис дисципліни

МЕТА: формування системи фундаментальних теоретичних знань і практичних навиків щодо побудови та аналізу економетричних моделей, та прогнозування на їх основі.

ПРОГРАМА: Предмет економетрики. Проста лінійна регресія. Метод найменших квадратів для оцінки параметрів простої лінійної регресії. Властивості оцінок параметрів регресії, отриманих методом найменших квадратів. Множинна лінійна регресія. Застосування методу найменших квадратів для оцінки параметрів множинної лінійної регресії. Статистичні висновки в моделі множинної лінійної регресії. Інтерпретація регресійних коефіцієнтів. Порівняння факторів за ступенем їх впливу. Фіктивні змінні. Порушення основних припущень класичного кореляційно-регресійного аналізу. Мультиколінеарність: виявлення; наслідки мультиколінеарності змінних на оцінки методу найменших квадратів. Гетероскедастичність: виявлення; наслідки гетероскедастичності збурень на оцінки методу найменших квадратів; доступний зважений метод найменших квадратів. Автокореляція: виявлення; наслідки автокорельованості збурень на оцінки методу найменших квадратів; побудова та оцінка регресійної моделі з автокорельованими збуреннями. Прогнозування на підставі економетричних моделей.

Форми та методи навчання: індивідуальні лабораторні завдання, вивчення додаткових розділів курсу.

Список рекомендованої літератури:

1. Економетрія. Підручник. Затверджено МОН / Здрок В.В., Лагоцький Т.Я. — К., 2010. — 541 с., тв. пал., (ст. 5 пр.).
2. Доугерти К. Введение в эконометрику: Пер. с англ. — М: ИНФРА-М, 1999. -402 с.