

**1. Назва.** Прикладна економетрія

**2. Шифр.** БД 4

**3. Тип.** Базова

**4. Рік навчання.** 2019-2020

**5. Семестр.** I

**6. Кількість кредитів ЄКТС - 5.**

**7. ШБ лектора, науковий ступінь, посада.**

Гур'янова Лідія Семенівна, д.е.н., проф., зав. кафедри економічної кібернетики

**8. Результати навчання:**

здатність збирати, аналізувати та обробляти статистичні дані, науково-аналітичні матеріали, які необхідні для розв'язання комплексних економічних завдань;

здатність використовувати сучасні інформаційні технології та економіко-математичні методи і моделі для дослідження економічних та соціальних процесів;

здатність до застосування економетричних методів дослідження масових соціально-економічних процесів для цілей прогнозування та управління ними;

здатність до розробки сценаріїв і стратегій розвитку соціально-економічних систем.

**9. Обов'язкові попередні навчальні дисципліни.**

Макроекономіка, Мікроекономіка, Економіка підприємства, Фінанси, Теорія імовірностей і математичної статистики, Теорія випадкових процесів, Економетрика, Прогнозування соціально-економічних процесів

**10. Зміст.**

Роль економетричних досліджень в економіці. Особливості економетричного моделювання. Етапи економетричного моделювання. Множинна лінійна регресія. Побудова моделей в умовах мультиколінеарності незалежних змінних. Методи оцінки коефіцієнтів моделей з нестандартними помилками. Нелінійна регресія. Вибір і порівняння регресійних моделей. Виробнича функція Кобба–Дугласа, її властивості й оцінка параметрів. Характеристики виробничої функції (середня і гранична продуктивність ресурсу, еластичність випуску продукції за витратами ресурсів, ізокванти і взаємозамінність ресурсів, ізокліналь). Економетричні моделі на основі системи структурних рівнянь. Моделі з дискретними змінними. Фіктивні змінні. Моделі множинного вибору. Моделі панельних даних. Моделі розподіленого лага. VAR та ЕСМ-моделі.

**11. Рекомендовані джерела.**

1. Бабешко Л.О. Основы економетрического моделирования. – М.: КомКнига, 2006. – 432 с.
2. Боровиков В. П. STATISTICA: искусство анализа данных на компьютере. Для профессионалов. – СПб: Питер, 2001. – 656с.

3. Геєць В. М. Моделі і методи соціально-економічного прогнозування: Підручник / Геєць В. М., Клебанова Т. С., Черняк О. І., Іванов В. В., Дубровіна Н. А., Ставицький А. В. – Х.: ВД “ІНЖЕК”, 2005. – 396 с.
4. Клебанова Т.С., Гур’янова Л.С., Прокопович С.В. та ін. Прикладна економетрика: навч. посібник, Частина І. - Харків: Вид. ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2016. – 236 с.
5. Клебанова Т.С., Гур’янова Л.С., Прокопович С.В. та ін. Прикладна економетрика: навч. посібник, Частина ІІ - Харків: Вид. ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2016. – 260 с.
6. Клебанова Т.С., Курзенев В.А., Наумов В. М., Гур’янова Л.С. та ін. Прогнозування соціально-економічних процесів. Навчальний посібник - Вид. ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2015. – 656 с.
7. Лук’яненко І.Г., Городніченко Ю.О. Сучасні економетричні методи у фінансах. – К.: Літера ЛТД, 2002. – 352 с.
8. Магнус Я. Р. Эконометрика. Я. Р. Магнус, П. К. Катышев, А. А. Пересецкий. – М.: Дело, 1997. – 248 с.
9. Тихомиров Н.П., Дорохина Е.Ю. Эконометрика – М.: Издательство “Экзамен”, 2003. – 512 с.
10. Уотшем Т.Дж., Паррамоу К. Количественные методы в финансах. – М.: Финансы, ЮНИТИ, 1999 – 527 с.

## **12. Методи навчання.**

Лекції, лабораторні заняття, лекції проблемного характеру, робота в малих групах, комп’ютерна симуляція, презентації.

## **13. Методи оцінювання:**

- поточний контроль (активна робота на лекційних заняттях, активна участь у виконанні лабораторних завдань, проведення поточних контрольних робіт, виконання індивідуального науково-дослідного завдання);
- модульний контроль (комплексна контрольна робота);
- підсумковий контроль (іспит).

## **14. Мова навчання.** Українська