

ОПИС ПРЕДМЕТА КУРСУ
Предмет: ПРИКЛАДНА ЕКОНОМЕТРИКА

Факультет: економічний

Курс 5

Обов'язковий: X

Вибірковий:

Річний:

1 семестр: X

2 семестр:

Лабораторні: 9 занять по 2 год.

Проект:

Загальна кількість

годін: 108

Години на тиждень:

Теорія: 18, лабораторні 18

КОД:

ECTS 3,5 кредитів

МЕТА: вивчення методів побудови адекватних економетричних моделей та прогнозу поведінки реальних економічних процесів на підставі використання сучасних програмних заходів.

ПРОГРАМА: Специфікація регресійних моделей. Означення і елементарний аналіз моделей з розподіленими лагами. Методи оцінювання моделей з розподіленими лагами. Системи одночасних рівнянь. Проблема ідентифікації. Методи оцінювання: непрямий метод найменших квадратів; двохетапний і трьохетапний метод найменших квадратів. Моделі з дискретною залежною змінною. Моделі з панельними даними. Нелінійна регресія. Огляд припущень моделі нелінійної регресії. Консистентність оцінки дисперсії збурень та асимптотична дисперсія МНК-оцінок. Принцип максимальної правдоподібності. Критерій відношення правдоподібності. Критерій Вальда. Критерій множників Лагранжа.

БІБЛЮГРАФІЯ:

1. Chervanyov D.M., Komashko O.V. *Econometrics: a course of lectures.* - Kyiv, 1998
2. Greene W.H. *Econometric Analysis.* - N.Y., 1993
3. Verbeek M. *A Guide to Modern Econometrics.* - N.Y., 1999

МЕТОДИ ОЦІНЮВАННЯ:

Семінари/презентації	10%
Індивідуальна робота	20%
Case study	30%
Фінальне тестування	40%

ПЕРЕДУМОВИ:

Математична статистика, Теорія Ймовірностей, Мікро- та Макроекономіка

ІНДИВІДУАЛЬНА РОБОТА: Case study: побудова економетричної моделі для дослідження індексу ділової активності на фондовому ринку України