

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ**  
**Східноєвропейський національний університет ім. Лесі Українки**

Кафедра обліку та аудиту

**ЗАТВЕРДЖЕНО**

Проректор з навчальної роботи

Проф. Гаврилюк С.В. \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_ 201\_\_р.

**ЕКОНОМЕТРИКА**

**Програма**  
**нормативної навчальної дисципліни**

<b>підготовки</b>	бакалавра
<b>галузі знань</b>	0305 Економіка і підприємництво
<b>напряму підготовки</b>	6.030509 «Облік і аудит»
	6.030508 «Фінанси і кредит»
	6.030504 «Економіка підприємства»

Програма навчальної дисципліни «Економетрика» для студентів за напрямом підготовки 6.030509 «Облік і аудит», 6.030508 «Фінанси і кредит», 6.030504 «Економіка підприємства»

" 01 " червня 2013 р. – 6 с.

**Розробник:** Бегун С.І., доцент кафедри обліку і аудиту, к.е.н.

**Рецензент:** Ліпич Л.Г., зав. кафедри економіки та безпеки підприємства, проф., д.е.н.

**Програма навчальної дисципліни «Економетрика»  
затверджена на засіданні кафедри обліку і аудиту**

протокол № 8 від 19.06.2013 р.

Завідувач кафедри: \_\_\_\_\_ (проф.. Жиглей І.В.)

**Програма навчальної дисципліни «Економетрика»  
схвалена науково-методичною комісією  
інституту економіки та менеджменту**

протокол №10 від 27.10. 2013 р.

Голова науково-методичної комісії  
Інституту економіки та менеджменту \_\_\_\_\_ (доц.. Бегун С.І)

**Програма навчальної дисципліни «Економетрика»  
схвалена науково-методичною радою університету**

протокол №2 від 23.10.2013 р.

## **Вступ**

Програма навчальної дисципліни “Економетрика” складена відповідно до освітньо-професійної програми підготовки освітньо-кваліфікаційного рівня бакалавра, напряму підготовки 6.030509 «Облік і аудит», 6.030508 «Фінанси і кредит», 6.030504 «Економіка підприємства».

**Предметом** навчальної дисципліни “Економетрика” є кількісне оцінювання залежностей між економічними показниками деякого економічного об’єкту (процесу) – розробка економетричних моделей та їх використання у дослідженні і управлінні економічними системами.

**Міждисциплінарні зв'язки:** після вивчення дисциплін “Вища математика”, “Математичне програмування”, “Теорія ймовірностей і математична статистика”, “Статистика”, “Оптимізаційні методи і моделі”; передуює вивченню дисциплін “Фінансовий аналіз”, “Банківська система”, “Фінанси”, “Податкова система”, “Інформаційні системи в обліку і фінансах” тощо

Програма навчальної дисципліни складається з таких **змістових модулів:**

1. Загальні поняття і засади економетричного моделювання.
2. Класичні економетричні моделі та її узагальнення

### **1. Мета та завдання навчальної дисципліни**

1.1. Метою викладання навчальної дисципліни «Економетрика» є вивчення методів оцінювання параметрів залежностей, які характеризують кількісні взаємозв'язки між економічними показниками, а також використання економетричних моделей в економічних дослідженнях, у практиці управління економічними процесами на різних ієрархічних рівнях національної економіки.

1.2. Основними завданнями вивчення дисципліни «Економетрика» є вивчення основних понять, ідей, систем і інструментарію економетрії; набуття практичних навичок конструювання та дослідження економетричних моделей; формування нового економіко-математичного мислення, спрямованого на підготовку фахівців-економістів нової формації.

1.3. Згідно з вимогами освітньо-професійної програми студенти повинні:

**знати:**

- суть і види економетричних моделей, що застосовуються для опису взаємозв'язків між економічними явищами;

- теоретичні основи економетричного дослідження як способу формування інформаційної бази для дослідження економічного середовища та прийняття управлінських рішень;

- методичні підходи до побудови економетричних моделей та перевірки їх якості;

- методику прогнозування та моделювання соціально - економічних параметрів.

**вміти:**

- застосовувати методи статистичного спостереження для формування масиву первинних даних для статистичного дослідження;

- виконувати необхідні аналітичні розрахунки із застосуванням комп'ютерної техніки у відповідності із метою економетричного дослідження, наявною вихідною статистичною інформацією;

- перевіряти статистичну значущість моделі в цілому, перевірка статистичної значимості параметрів моделі і коефіцієнта кореляції;

- будувати інтервали довіри для параметрів моделі і здійснювати їх інтерпретацію;

- прогнозувати економічні показники на основі економетричних моделей.

На вивчення навчальної дисципліни відводиться 108 годин / 3 кредити ECTS.

### **3. Інформаційний обсяг навчальної дисципліни**

***Змістовий модуль 1.***

***Загальні поняття і засади економетричного моделювання***

**Тема 1. Вступ до економетрики**

Визначення дисципліни, її предмет, об'єкт і завдання. Роль економетричних досліджень в економіці. Виникнення, розвиток і становлення

економетрики.

## **Тема 2. Математичне моделювання як метод наукового пізнання економічних явищ і процесів**

Етапи економіко-математичного моделювання. Кореляційно-регресійний аналіз в економіці. Визначення і типи економетричних моделей. Класифікація економетричних моделей. Етапи і задачі економетричного дослідження.

## **Тема 3. Загальна лінійна економетрична модель**

Визначення загальної лінійної економетричної моделі. Теоретична (дійсна) і вибіркова (емпірична) модель. Умови Гауса-Маркова. Прогнозування економічних показників на основі загальної лінійної економетричної моделі. Економіко-математичний аналіз на основі загальної лінійної економетричної моделі.

### ***Змістовий модуль 2.***

### ***Класичні економетричні моделі та їх узагальнення***

## **Тема 4. Множинна лінійна модель**

Множинний лінійний регресійний аналіз. Класична багатофакторна регресія. Перевірка статистичної значимості моделі в цілому. Перевірка статистичної значимості параметрів моделі і коефіцієнта кореляції. Методи побудови множинних регресій. Загальне поняття про нелінійну регресію. Типи нелінійних моделей.

## **Тема 5. Мультиколінеарність**

Поняття мультиколінеарності, її природа і причини виникнення. Види і наслідки мультиколінеарності. Тестування наявності мультиколінеарності. Шляхи і засоби усунення мультиколінеарності.

## **Тема 6. Узагальнений метод найменших квадратів**

Поняття гетероскедастичності залишків, її природа і причини виникнення. Наслідки гетероскедастичності. Тестування наявності гетероскедастичності. Оцінювання параметрів економетричної моделі при наявності гетероскедастичності.

### **3. Форма підсумкового контролю успішності навчання**

Підсумковий контроль проводиться у формі екзамену.

### **4. Методи та засоби діагностики успішності навчання**

Діагностика успішності включає тестування, розв'язування задач, опитування, ділова гра, самостійна робота.

### **5. Список джерел**

1. Економетрія / В. В. Здрок, Т. Я. Лагоцький (+компакт диск). – К. : Знання, 2010. – 118 с.
2. Економетрія : [навч. посіб.] / за ред.. О. А. Корольова – К. : Книга, 2005. – 164 с.
3. Кремер Н. Ш. Эконометрика: [Учебник для вузов] / Н. Ш. Кремер, Б. А. Путко – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2005. – 311 с.
4. Кузьмичов А. І. Економетрія. Моделювання засобами MS Excel: [навчальний посібник]/ А. І. Кузьмичов – К. : ЦУЛ, 2011. – 214 с.
5. Лещинський О. Л. Економетрія / О. Л. Лещинський – К. : МАУП, 2003. – 208 с.
6. Лугінін В. М. Економетрія: [навч. посіб.] / В. М. Лугінін – К. : ЦНЛ, 2008. – 312 с.
7. Наконечний С. І. Економетрія. / С. І. Наконечний, Т. О. Терещенко – К. : КНЕУ, 2006. – 528 с
8. Скоков Б. Г. Конспект лекцій до курсу «Економетрія» / Б. Г. Скоков, К. А. Мамонов – Харків : ХНАМГ, 2006 – 105 с.
9. Толбатов Ю. А. Эконометрика: [Підручник для студентів]./ Ю. А. Толбатов – Тернопіль: Підручники і посібники, 2008. – 288 с.