

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ СЕМЕНА КУЗНЕЦЯ

«Економетрика та моделювання динамічних процесів»

(назва навчальної дисципліни)

**МЕТОДИЧНІ РЕКОМЕНДАЦІЇ
до самостійної роботи
з навчальної дисципліни
підготовки докторів філософії**

зі спеціальності 051 «Економіка»

(шифр і назва спеціальності)

2016 рік

РОЗРОБЛЕНО ТА ВНЕСЕНО: кафедрою економічної кібернетики ХНЕУ ім. С. Кузнеця, протокол № 12 від 18.04.2016р.

РОЗРОБНИК: Гур'янова Л.С., д.е.н., доцент, професор кафедри економічної кібернетики ХНЕУ ім. С. Кузнеця

1. ЗАГАЛЬНІ ВІДОМОСТІ

Самостійна робота здобувача (СРЗ) – це форма організації навчального процесу, за якої заплановані завдання виконуються здобувачем самостійно під методичним керівництвом викладача.

Метою самостійної роботи здобувача в межах навчальної дисципліни «Економетрика та моделювання динамічних процесів» є засвоєння в повному обсязі навчальної програми та формування у здобувачів загальних і професійних компетентностей, які відіграють суттєву роль у становленні майбутнього доктора філософії.

Навчальний час, відведений для самостійної роботи здобувачів очної форми навчання, визначається навчальним планом і становить 75% (112 годин) від загального обсягу навчального часу на вивчення дисципліни (150 годин).

У ході самостійної роботи здобувач має перетворитися на активного учасника навчального процесу, навчитися свідомо ставитися до оволодіння теоретичними і практичними знаннями, вільно орієнтуватися в інформаційному просторі, нести індивідуальну відповідальність за якість власної освітньо-наукової діяльності.

СРЗ в межах навчальної дисципліни «Економетрика та моделювання динамічних процесів» включає:

опрацювання лекційного матеріалу;

опрацювання та вивчення рекомендованої літератури, основних термінів та понять за темами дисципліни;

підготовку до лабораторних занять;

поглиблене опрацювання окремих лекційних тем або питань;

пошук (підбір) та огляд літературних джерел за заданою проблематикою дисципліни;

контрольну перевірку здобувачами особистих знань за запитаннями для самодіагностики;

підготовку до контрольних робіт та інших форм поточного контролю.

2. ЗАВДАННЯ ДЛЯ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ

Завдання самостійної роботи, які передбачені навчальним планом і програмою навчальної дисципліни для засвоєння теоретичних знань і практичних навичок, наведені в табл. 2.1.

Таблиця 2.1

Завдання для самостійної роботи здобувачів та форми її контролю

| № з/п | Компетентності, які забезпечуються | Назва теми | Завдання для самостійної роботи | Кількість годин | Форми контролю СРЗ | Література |
|-------|---|------------|---------------------------------|-----------------|--------------------|------------|
| | <i>Змістовний модуль 1. Економетричні моделі зі специфічними змінними</i> | | | | | |

| № з/п | Компетентності, які забезпечуються | Назва теми | Завдання для самостійної роботи | Кількість годин | Форми контролю СРЗ | Література |
|-------|---|--|--|-----------------|---|------------------------------------|
| 1 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 1. Проблеми побудови економетричних моделей | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 6 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |
| 2 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 2. Моделі з фіктивними незалежними змінними | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 8 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |
| 3 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 3. Моделі з дискретними залежними змінними | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 8 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |

| № з/п | Компетентності, які забезпечуються | Назва теми | Завдання для самостійної роботи | Кількість годин | Форми контролю СРЗ | Література |
|-------|---|--|--|-----------------|---|------------------------------------|
| 4 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 4. Моделі з обмеженими залежними змінними | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 6 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |
| 5 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 5. Моделі панельних даних | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 8 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | |
| 6 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 1-Тема 5 | Виконання індивідуального науково-дослідного завдання (ІНДЗ) | 25 | Захист ІНДЗ | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |

| № з/п | Компетентності, які забезпечуються | Назва теми | Завдання для самостійної роботи | Кількість годин | Форми контролю СРЗ | Література |
|---|---|--|--|-----------------|---|------------------------------------|
| Разом за змістовим модулем І | | | | 61 | | |
| Змістовний модуль 2. Динамічна економетрика | | | | | | |
| 7 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 6. Методи генерації прогнозних вибірок | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 6 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |
| 8 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 7. Адаптивні моделі з адаптивними параметрами адаптації | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 6 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |
| 9 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку | Тема 8. VAR-моделі та моделі корегування помилки | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 8 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |

| № з/п | Компетентності, які забезпечуються | Назва теми | Завдання для самостійної роботи | Кількість годин | Форми контролю СРЗ | Література |
|--------------------------------------|---|--|--|-----------------|---|--|
| | економічних систем | | | | | |
| 10 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 9. Загальні моделі з авторегресійною умовною гетероскедастичністю | Вивчення лекційного матеріалу, підготовка до лабораторних занять, виконання індивідуального завдання, підготовка до контрольної роботи | 6 | Експрес-опитування Захист індивідуального завдання | |
| 11 | здатність здійснювати теоретичний та прикладний економетричний аналіз здатність застосовувати динамічні економетричні моделі для обґрунтування гіпотез щодо закономірностей динаміки розвитку економічних систем | Тема 6-9 | Виконання індивідуального науково-дослідного завдання (ІНДЗ) | 25 | Захист ІНДЗ | Основна: [1-5]. Додаткова: 6-9] |
| Разом за змістовим модулем II | | | | | | 51 |
| Разом з навчальної дисципліни | | | | | | 112 |

3. СИСТЕМА ОЦІНЮВАННЯ УСПІШНОСТІ САМОСТІЙНОЇ РОБОТИ

Виконання кожного завдання для самостійної роботи оцінюється відповідно до Тимчасового положення "Про порядок оцінювання результатів навчання студентів за накопичувальною бально-рейтинговою системою" ХНЕУ ім. С. Кузнеця (табл. 3.1).

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

| Сума балів за всі види навчальної діяльності | Оцінка ЄКТС | Оцінка за національною шкалою | |
|--|-------------|--|---------------|
| | | для екзамену, курсового проекту (роботи), практики | для заліку |
| 90 – 100 | A | відмінно | зараховано |
| 82 – 89 | B | добре | |
| 74 – 81 | C | | |
| 64 – 73 | D | задовільно | |
| 60 – 63 | E | | |
| 35 – 59 | FX | незадовільно | не зараховано |
| 1 – 34 | F | | |

Розподіл балів за виконання завдань для самостійної роботи у межах тем змістових модулів навчальної дисципліни наведено в табл. 3.2.

Таблиця 3.2

Розподіл балів за завданнями та змістовними модулями

| Завдання для самостійної роботи | Змістовий модуль 1 | | | | | | Змістовий модуль 2 | | | | | Сума балів |
|---------------------------------|--------------------|------|------|------|------|------|--------------------|------|------|------|------|------------|
| | ЗСР1 | ЗСР2 | ЗСР3 | ЗСР4 | ЗСР5 | ІНД3 | ЗСР6 | ЗСР7 | ЗСР8 | ЗСР9 | ІНД3 | |
| Максимальна кількість балів | 5 | 5 | 5 | 6 | 7 | 10 | 5 | 6 | 6 | 5 | 10 | 70 |

ЗСР– завдання для самостійної роботи здобувача.

Оцінки за цією шкалою заносяться до відомостей обліку успішності та іншої академічної документації.

4. РЕКОМЕНДОВАНА ЛІТЕРАТУРА

Основна:

1. Геєць В.М. Клебанова Т.С. Черняк О.І. Іванов В.В. та ін. Моделі і методи соціально-економічного прогнозування: Підруч. для вищ. навч. закл Х.:ІНЖЕК,2005 .-392 с.
2. Гур'янова Л.С., Клебанова Т.С., Сергієнко О.А., Прокопович С.В. Економетрика. Навчальний посібник -Харків: Вид. ХНЕУ ім. С. Кузнеця, 2015. – 389 с.

3. 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.
4. Лук'яненко І.Г., Городніченко Ю.О. Сучасні економетричні методи у фінансах. – К.: Літера ЛТД, 2002. – 352 с.
5. Тихомиров Н.П., Дорохина Е.Ю. Эконометрика – М.: Издательство “Экзамен”, 2003. – 512 с.

Додаткова:

6. Бессалов А.В. Эконометрика - К.:Кондор, 2007. – 193 с.
7. Магнус Я. Р. Эконометрика. Я. Р. Магнус, П. К. Катышев, А. А. Пересецкий. – М.: Дело, 1997. – 248 с.
8. Орлов. А. Н. Эконометрика – М.: Изд. “Экзамен”, 2002. – 576 с.
9. Уотшем Т.Дж., Паррамоу К. Количественные методы в финансах. – М.: Финансы, ЮНИТИ, 1999 – 527 с.

Ресурси Інтернет:

10. Сайт Держкомстату України - www.ukrstat.gov.ua
11. Сайт Національного банку України - www.bank.gov.ua
12. Сайт Національної бібліотеки України ім. Вернадського - www.nbuv.gov.ua.
13. Сайт наукової бібліотеки на УКМА - www.librari.ukma.kiev.ua.