

2020/2021

СТАТИСТИЧНІ МЕТОДИ ПРОГНОЗУВАННЯ В МІЖНАРОДНОМУ БІЗНЕСІ СИЛАБУС

1. ДИСЦИПЛІНА «СТАТИСТИЧНІ МЕТОДИ ПРОГНОЗУВАННЯ В МІЖНАРОДНОМУ БІЗНЕСІ» ВИВЧАЄ:

Статистичні методи прогнозування (трендові моделі, сезонні і циклічні складові економічних часових рядів, методи згладжування часових рядів, методи багатовимірної регресії тощо)

Ситуації та умови міжнародного бізнес середовища, за яких є доцільним застосування тих чи інших різноманітних статистичних моделей і методів для прогнозування

Моделі взаємозв'язків процесів міжнародних економічних відносин, їх змістовний аналіз і прогнозування

Мета

Метою вивчення дисципліни «Статистичні методи прогнозування в міжнародному бізнесі» є вивчення основних статистичних моделей і методів прогнозування у сучасній світовій практиці.

Перелік тем

1. Теоретичні основи прогнозування
2. Основні статистичні показники часових рядів
3. Сезонні часові ряди і трендовий аналіз процесів міжнародного бізнесу
4. Прогнозування на основі методів згладжування часових рядів
5. Одиничні корені та структурні зміни в процесах міжнародного бізнесу
6. Прогнозування процесів міжнародного бізнесу за допомогою моделей інтегрованої авторегресії – ковзного середнього.
7. Прогнозування процесів міжнародного бізнесу на основі моделей регресії
8. Моделювання взаємозв'язків та прогнозування процесів міжнародного бізнесу
9. Моделювання довготермінових взаємозв'язків міжнародних процесів та їх прогнозування на основі моделей корекції помилки
10. Моделювання і прогнозування волатильності в часових рядах процесів міжнародного бізнесу
11. Моделі панельних даних в міжнародному бізнесі

Пререквізити: "Вища математика для економістів", "Статистика", "Статистика ринку товарів та послуг", "Економіко-математичне моделювання"

Обсяг: 6 кредитів (14 лекцій (28 годин), 14 семінарів (28 годин), 136 годин самонавчання
Мова: українська

Оцінка (за семестр): практичні роботи, завдання для самостійного вивчення.

Оцінка (підсумкова): екзамен - 100 балів.

Навчально-методичне забезпечення: конспекти лекцій, матеріали лекцій та презентації, завдання для семінарів, додаткові посилання надсилаються студентам.

Підготовка до лекцій та ознайомлення з додатковою літературою спрямоване на краще сприйняття лекційного матеріалу, повне засвоєння дисципліни

Список літератури:

1. Економічні дослідження (методологія, інструментарій, організація, апробація) : навч. посіб. / В. М. Геєць [та ін.] ; за ред. д-ра екон. наук, проф., акад. НАПН України А. А. Мазаракі ; Київ. нац. торг.-екон. ун-т. - К. : б. в.], 2010. – 279 с.
2. Бахрушин В.Є. Методи аналізу даних: навчальний посібник для студентів / В.Є.Бахрушин . – Запоріжжя: КПУ, 2011. – 268 с.
Режим доступу:
[http://www.researchgate.net/publication/235825660_The_Methods_of_Data_Analysis_\(in_Ukrainian\)](http://www.researchgate.net/publication/235825660_The_Methods_of_Data_Analysis_(in_Ukrainian)).
3. Лук'яненко І. Г. Аналіз часових рядів. Частина перша : Побудова ARIMA, ARCH/GARCH моделей з використанням пакета E.Views 6.0 : практичний посібник для роботи в комп'ютерному класі / І. Г. Лук'яненко, В. М. Жук ; Нац. ун-т "Києво-Могилян. акад.". - К. : [НаУКМА], 2013. - 187 с.
4. Лук'яненко І. Г. Аналіз часових рядів. Частина друга : побудова VAR і VECM моделей з використанням пакета E.Views 6.0 : практичний посібник для роботи в комп'ютерному класі / І. Г. Лук'яненко, В. М. Жук ; Нац. ун-т "Києво-Могилян. акад.". - К. : [НаУКМА], 2013. - 174 с.
5. Лук'яненко І.Г., Городніченко Ю.О. Сучасні економетричні методи у фінансах. Навчальний посібник. – К.: Літера ЛТД, 2002. – 352 с.

Інтернет-джерела

1. Офіційний сайт Державної служби статистики України – www.ukrstat.gov.ua
2. <http://gretl.sourceforge.net/index.html> — сайт спільноти пакету економетричного моделювання GRETl.
3. <http://www.r-project.org/> – Інтернет-сайт середовища програмування і пакетів статистичних програм і графіки R.

Політика академічної доброчесності:

<https://knute.edu.ua/file/NjY4NQ==/bf27ad9293fa2bb6f9b2c3031d4b6e4a.pdf>

Викладач:

Чорний Антон Юрійович

Кандидат економічних наук, доцент

Доцент кафедри статистики та економетрії

E-mail: a.chorny@knute.edu.ua

Тел.: 044-531-47-19