*Г. В. Карнаухова*

*Вищий навчальний заклад Укоопспілки*

*«Полтавський університет економіки і торгівлі»*

ВИКОРИСТАННЯ СПЕЦІАЛІЗОВАНИХ ЕКОНОМЕТРИЧНИХ ПАКЕТІВ

Підготовка фахівців з економічної кібернетики передбачає оволодіння студентами основним модельним інструментарієм сучасної економетрики та його застосування до моделювання економічних процесів. Важливими завданнями фахової підго- товки є опанування сучасних методів побудови та оцінювання економетричних моделей, набуття навичок вимірювання взаємо- зв’язків між економічними змінними, використання результатів економетричного аналізу для прогнозування та прийняття нау- ково-обґрунтованих рішень.

В процесі опанування курсу «Прикладна економетрика» ма- гістри спеціальності 051 «Економіка» освітньої програми «Еко- номічна кібернетика» використовують інструментарій сучасного прикладного аналізу не тільки з Data Analysis «Microsoft Excel» але і спеціалізований економетричний пакет EViews – одним з світових лідерів в області економетричного програмного забез- печення, що поєднує потужність і простоту використання. EViews дозволяє швидко і ефективно керувати даними, здійсню- вати економетричний та статистичний аналіз, генерувати про- гнози, розробляти високоякісні графічні моделі і таблиці для публікації або включення в інших додатках. Завдяки інновацій- ному графічному об’єктно-орієнтованому користувацькому ін- терфейсу, EViews поєднує краще з сучасної технології програм- ного забезпечення з функціями складного механізму аналізу.

Але в наш складний час, коли сучасне виробництво потребує самостійних, творчих фахівців, ініціативних підприємливих, здатних приносити прибуток, пропонувати і розробляти ідеї, знаходити нетрадиційні рішення і реалізовувати економічно вигідні проекти слід звернути увагу на сучасне кросплатформне спеціалізоване економетричне забезпечення з відкритим кодом.

Gretl – крос-платформений програмний пакет для економет- ричного аналізу, написаний мовою Сі за ліцензією GNU General Public License, що має наступні особливості:

Багато методів оцінювання: найменших квадратів (LS), ма- ксимальної правдоподібності (ML), узагальнений метод момен- тів (GMM), метод одного рівняння і систем рівнянь;

Інструментарій для аналізу часових рядів: ARIMA, широкий спектр одновимірних GARCH-моделей, VAR і VECM (вклю- чаючи структурний VAR), тести на одиничні корні і коінтегра- цію, фільтр Калмана тощо;

Моделі з обмеженою залежною змінною: логіт, пробіт, мо- делі зі зміщенням відбору (Тобіна, Хекмана тощо), інтервальна регресія, моделі тривалості тощо;

Оцінювання панельних моделей, включаючи інструментальні змінні, пробіт і динамічні панелі на основі узагальненого методу моментів (GMM);

Видача результатів в форматі LaTeX;

Містить потужну вбудовану скриптову мову hansl, що міс- тить значну кількість функцій для програмування і роботи з матрицями;

Циклічна структура команд для симуляцій методом Монте- Карло і ітераційних процедур оцінювання;

Графічний інтерфейс для тонкої настройки відображення гра- фіків gnuplot;

Постійно зростаюча база для користувача функціональних пакетів, написаних на hansl;

Інтеграція і обмін даними зі статистичними пакетами GNU R, GNU Octave, Ox і Stata.

JMulTi – інтерактивне програмне забезпечення з відкритим кодом для економетричного аналізу, що спеціалізується на одномірному та багатоваріантному аналізі часових рядів. Він має графічний користувальницький інтерфейс Java та забезпечує за- соби, за допомогою яких можна здійснити деякі економетричні процедури серії часу, що недоступні в інших прикладних паке- тах. Такі процедури включають аналіз імпульсних реакцій з ви- користанням завантажуваних довірчих інтервалів для моделю- вання VAR / VEC.

Отже використання широкого кола економетричних пакетів забезпечує посилення прикладного, практичного характеру си- стеми професійної підготовки, адекватність її сучасним вимогам економіки, науки і суспільного життя.

Список використаних інформаційних джерел

1. EViews 7 User’s Guide I Copyright 1994–2009 Quantitative Micro Software, LLC All Rights Reserved Printed in the United States of America [Електронний ресурс]. – Режим доступу: http://schwert.ssb.rochester.edu/a425/EV71.pdf. – Назва з екрана.

2. Gnu Regression, Econometrics and Time-series Library [Елек- тронний ресурс]. – Режим доступу: http://gretl.sourceforge.net/. – Назва з екрана.

3. JMulTi Time Series Analysis with Java [Електронний ресурс]. – Режим доступу: http://www.jmulti.de/. – Назва з екрана.