

1. Наслов на наставниот предмет		Предметна програма од прв циклус студии Применета економетрија				
2. Код		ECN450				
3.	Студиска програма	Економија				
4.	Организатор на студиската програма (единица, односно институт, катедра, оддел)	Универзитет „Св Кирил и Методиј“ во Скопје Економски факултет - Скопје				
5.	Степен(прв, втор, трет циклус)	прв				
6.	Академска година/семестар	Четврта година/Летен (осми) семестар	7.	Број на ЕКТС	7,5	
8.	Наставник	Проф. д-р Весна Буцевска				
9.	Предуслови за запишување на предметот	-				
10.	<p>Цели на предметната програма (компетенции): По завршувањето на наставата и полагавањето на овој предмет, студентите треба да бидат способни:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Да ги разберат и соодветни да ги применуваат избраните статистички и економетриски алатки кои вообичаено се користат во емпириските економски и бизнис анализи. • Да знаат како да ги оценат каузалните ефекти и да прават предвидувања со користење на податоци на пресек • Да ги оценат динамичките каузални ефекти и да вршат проекции со користење на податоци од временски серии. • Да го разберат концептот на методот на максимална веродостојност и да го толкуваат добиените оценки. • Да прават разграничување помеѓу фиксни и случајни ефекти и како истите да ги оценат. • Да ја разберат ендегеноста во моделите на симултани равенки и како да делуваат врз неа преку оценување со инструментални променливи. • Да ги оценат векторски авторегресивните модели. • Да ги имплементираат генерализираните авторегресивни условно хетероскедастични модели (Generalized Autoregressive Conditionally Heteroscedastic Models – GARCH Models) и моделите со стохастичка волатилност (Stochastic Volatility Models) за да го претстават динамичкото однесување на неизвесноста. • Да ги употребуваат економетриските модели за да тестираат различни финансиски хипотези и модели, како што се на пример, тестирањето на ефикасноста на пазарите, оценка на ризикот на поединечна акција преку пресметување на нејзината вредност под ризик (Value at Risk). • Да знаат како да ги толкуваат оценките добиени кај моделите со дискретен одговор. 					
11.	<p>Содржина на предметната програма: Областа на Применетата економетрија е брзо растечка како резултат на унапредување на компјутерските софтвери и зголемената достапност на податоците. Преку користење на економетриските пакети кои се достапни на пазарот не е потребно многу време да се оценат многу сложени модели. Предметот обработува дополнителни економетриски техники (кои не се опфатени во предметот Економетрија) кои се корисни за спроведување на емпириско економско истражување. Целта на предметот е да ги подготви студентите целосно да ракуваат со економетриските алатки за мерење, моделирање, толкување и предвидување на макро, микро-економски и финансиски појави. Предметот се фокусира на следните теми од економетријата: Линеарна повеќекратна регресија; Генерализиран</p>					



	метод на моменти; Метод на максимална веродостојност; Модел на капитално вреднување на средствата; Инструментални променливи; Модели на симултани равенки; Векторски авторегресивни модели (VAR; ARCH/GARCH модели; Модели со панел податоци и Модели со бинарни зависни променливи. Со изучување на материјата по предметот студентите се оспособуваат да спроведуваат нивно сопствено емпириско истражување и да ја разберат современата емпириска економска и бизнис литература. Предметот се концентрира на практичната примена на економетриските методи преку осврт на релевантната методологија, нејзината примена и можните алтернативни пристапи на моделирање. Предавањата се поддржани со компјутерски вежби со примена на економетриски пакети на кои студентите можат да стекнат практично искуство во применета економетриска анализа.					
12.	Методи на учење: Предавања со презентации, интерактивни предавања, тимска работа, гостин на предавања, студии на случај, изработка и презентација на проектна задача,					
13.	Вкупен расположлив фонд на време		7.5 ЕКТС x 30 часови=225 часови			
14.	Распределба на расположливо време		60+30+30+15+90 =225 часови			
15.	Форми на наставните активности	15.1.	Предавања-теоретска настава	60 часови		
		15.2.	Вежби (лабораториски, аудиториски), семинари, тимска работа	30 часови		
16.	Други форми на активности	16.1.	Проектни задачи	30 часови		
		16.2.	Самостојни задачи	15 часови		
		16.3.	Домашно учење	90 часови		
17.	Начин на оценување					
	17.1.	Тестови		60 бодови		
	17.2.	Семинарска работа/проект (презентација: писмена и усна), лабораториски вежби		30 бодови		
	17.3.	Активност и учество		10 бодови		
18.	Критериуми за оценување (бодови/оценка)		до 50 бода	5 (пет) (F)		
			од 51 до 60 бода	6 (шест) (E)		
			од 61 до 70 бода	7 (седум) (D)		
			од 71 до 80 бода	8 (осум) (C)		
			од 81 до 90 бода	9 (девет) (B)		
			од 91 до 100 бода	10 (десет) (A)		
19.	Услов за потпис и полагање на завршен испит		Реализирани активности			
20.	Јазик на кој се изведува наставата		Македонски			
21.	Метод на следење на квалитетот на наставата		интерна евалуација и анкета			
22.	ЛИТЕРАТУРА					
	22.1.	Задолжителна литература				
		Ред. број	Автор	Наслов	Издавач	Година
		1.	Asteriou, Dimitrios and S. G. Hall	Applied Econometrics, 4 th ed	London : Red Globe Press	2021.
		2.	Chris Brooks	Introductory Econometrics for Finance, 4th ed.	Cambridge University Press	2019
	3.	Весна Буцевска	Економетрија со примена на EViews	Економски факултет, Скопје	2016	



22.2.	Дополнителна литература				
	Ред. број	Автор	Наслов	Издавач	Година
	1.	Angrist, Joshua David, and Jörn-Steffen Pischke.	Mostly Harmless Econometrics: an Empiricist's Companion.	Princeton University Press	2009
	2.	Chung-ki Min	<i>Applied Econometrics A Practical Guide</i>	Routledge	2019
	3.	Enders, W.	"Introduction to Applied Econometrics"	Belmont, CA: Thomson Brooks/ Cole	2005
	4.	Kratzig, M. and H. Lutkepohl	"Applied Econometric Time Series", 2nd edition,	John Wiley & Sons, Inc.	2007
	5.	Tsay, R.S.	<i>Analysis of Financial Time Series</i> , 3 rd ed.	John Wiley, New York	2010
	6.	Wooldrige , Jeffrey M.	Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data	The MIT Press	2010
	7.	Гуџарати, Д. Н	<i>Основи на економетријата, 4то издание</i>	НАМПРЕС (превод од англиски, проект на Влада на Република Македонија)	2012