**Nazwa przedmiotu:**

Ekonometria

**Koordynator przedmiotu:**

Dr Jerzy Ploch

**Status przedmiotu:**

Obowiązkowy

**Poziom kształcenia:**

Studia II stopnia

**Program:**

Zarządzanie

**Grupa przedmiotów:**

Wspólne

**Kod przedmiotu:**

EKOME

**Semestr nominalny:**

1 / rok ak. 2010/2011

**Liczba punktów ECTS:**

5

**Liczba godzin pracy studenta związanych z osiągnięciem efektów uczenia się:**

**Liczba punktów ECTS na zajęciach wymagających bezpośredniego udziału nauczycieli akademickich:**

**Język prowadzenia zajęć:**

polski

**Liczba punktów ECTS, którą student uzyskuje w ramach zajęć o charakterze praktycznym:**

**Formy zajęć i ich wymiar w semestrze:**

|  |  |
| --- | --- |
| Wykład: | 450h |
| Ćwiczenia: | 450h |
| Laboratorium: | 0h |
| Projekt: | 0h |
| Lekcje komputerowe: | 0h |

**Wymagania wstępne:**

Prerekwizyty: zmienne objaśniane, zmienne objaśniające, zmienne bieżące, zmienne opóŹnione, zmienne endogeniczne, zmienne egzogeniczne, zmienne z góry ustalone, zmienne współzależne, parametry strukturalne, element losowy, model ekonometryczny, model liniowy, model nieliniowy, model z jedną zmienną, model z wieloma zmiennymi, model jednorównaniowy, model wielorównaniowy, postać strukturalna modelu, postać zredukowana modelu, model prosty, model rekurencyjny, model o równaniach współzależnych, identyfikowalność równania, równanie identyfikowalne jednoznacznie, równanie identyfikowalne niejednoznacznie, MNK, klasyczna MNK, uogólniona MNK, pośrednia MNK, podwójna MNK, wartość empiryczna zmiennej, wartość teoretyczna zmiennej, reszty modelu, estymatory parametrów, macierz wariancji i kowariancji estymatorów, błędy standardowe estymatorów, współczynnik zmienności, współczynnik zbieżności, współczynnik determinacji, przedziały ufności parametrów, istotność parametrów, jednorodność wariancji składnika losowego, autokorelacja składników losowych, prognoza punktowa, standardowy błąd prognozy, prognoza przedziałowa, wartość przeciętna, przyrost krańcowy, stopa wzrostu, elastyczność cząstkowa, modele Tornquista, model logistyczny, model Cobba-Douglasa, model CES, model Zellnera i Revankora, model translogarytmiczny.

**Limit liczby studentów:**

**Cel przedmiotu:**

Zapoznanie studentów z najważniejszymi modelami ekonometrycznymi, podstawami teorii estymacji i regresji. Przedstawienie metod statystycznych pozwalających na badanie i wykrywanie związków ekonometrycznych zachodzących między różnymi zjawiskami ekonometrycznymi takimi jak: popyt, podaż, dochód, cena, itp.. Zastosowanie otrzymanych związków do przewidywania interesujących nas zjawisk ekonomicznych zachodzących w gospodarce. Przedmiot dostarcza narzędzi analitycznych pozwalających na opisywanie mechanizmu kształtowania się zjawisk ekonomicznych oraz przewidywania dalszego ich przebiegu i sterowania tymi zjawiskami.

**Treści kształcenia:**

WYKŁAD 1. Model ekonometryczny. 2. Wybór postaci analitycznej modelu i dobór zmiennych. 3. Estymatory parametrów modelu liniowego z jedną zmienną. 4. Błędy standardowe składnika losowego i estymatorów. 5. Miary dopasowania modelu oraz przedziały ufności i istotność parametrów. 6. Wektor estymacji parametrów modelu linowego z wieloma zmiennymi. 7. Błędy standardowe estymatorów i miary dopasowania modelu. 8. Weryfikacja założeń modelu liniowego. 9. Estymacja parametrów modelu uogólnioną MNK. 10. Estymacja parametrów strukturalnych modelu nieliniowego. 11. Prognozowanie ekonometryczne. 12. Prognozy na podstawie jednorównaniowego modelu ekonometrycznego. 13. Klasyfikacja modeli wielorównaniowych. 14. Estymacja parametrów w modelu jednoznacznie identyfikowalnym. 15. Estymacja parametrów w modelu niejednoznacznie identyfikowalnym. ĆWICZENIA 1. Modele ekonometryczne lineryzowalne. 2. Dobór zmiennych do modelu liniowego. 3. Wyznaczanie estymatorów parametrów modelu MNW. 4. Szacowanie parametrów modelu liniowego z jedną zmienną objaśniającą. 5. Wyznaczanie miar dopasowania, przedziały ufności i istotność parametrów. 6. Szacowanie parametrów modelu liniowego z wieloma zmiennymi. 7. Wyznaczanie przedziałów ufności parametrów i istotności parametrów. 8. Praca kontrolna 1. 9. Weryfikacja założeń klasycznego modelu liniowego. 10. Specjalne metody wyznaczania estymatorów parametrów modelu. 11. Wyznaczanie prognoz punktowych i przedziałowych. 12. Postać strukturalna i zredukowana wielorównianiowego modelu liniowego. 13. Badanie identyfikowalności modelu o równaniach współzależnych. 14. Szacowanie parametrów strukturalnych modelu wielorównaniowego. 15. Praca kontrolna 2.

**Metody oceny:**

brak

**Egzamin:**

**Literatura:**

1. A. Welfe: Ekonometria, PWN, Warszawa, 1998r. 2. W. Sadowski: Ekonometria, Wyd. PWSHiP, Warszawa, 1996r. 3. M. Podgórska i inni: Ekonometria, OWSGH, Warszawa, 1998r. 4. B. Guzik i inni: Ekonometria i badania operacyjne, WAE, Poznań, 2002r. 5. E. Nowak, Zarys metod ekonometrii, PWN, Warszawa 1998r. 6. W. Rzymowski, Ekometria w przykładach i zadaniach, KARPINT, Lublin 1999r. 7. A. Welfe i inni, Ekonometria-zbiór zadań, PWE, Warszawa 1997r. 8. K. Kukuła i inni, Wprowadzenie do ekonometrii w przykładach i zadaniach, PWN,Warszawa 1996r.

**Witryna www przedmiotu:**

**Uwagi:**

## Efekty przedmiotowe