

| EKONOMETRIA |
|---|
| Cele kształcenia |
| zapoznanie studentów z podstawami tworzenia modeli ekonometrycznych, ich weryfikacji oraz wykorzystania |
| Wymagania |
| Znajomość podstaw algebry liniowej, analizy matematycznej oraz rachunku prawdopodobieństwa i statystyki. |
| Treści programowe |
| <ul style="list-style-type: none"> • Model ekonometryczny, struktura modelu, zasady interpretacji parametrów. • Klasyczny model regresji liniowej – założenia stochastyczne i numeryczne. • Estymacja modelu - estymator metody najmniejszych kwadratów i jego własności. • Weryfikacja modelu (ekonomiczna i statystyczna). Testy t-Studenta, F-Snedecora i Durбина-Watsona. • Mierniki dopasowania modelu do danych empirycznych. Wnioskowanie o jakości dopasowania. • Wnioskowanie o stałości wariancji składników losowych oraz braku ich skorelowania. • Predykcja ekonometryczna. Elementy prognozowania, szacowanie błędów prognozy. • Modele nieliniowe, metody estymacji parametrów modeli nieliniowych. • Zastosowania regresji liniowej i nieliniowej w analizie i programowaniu zjawisk ekonomicznych |
| Wykaz literatury |
| <ul style="list-style-type: none"> • T. Kufel, Ekonometria. Rozwiązywanie problemów z wykorzystaniem programu Gretl, PWN Warszawa 2004 • K. Kukuła (red), Wprowadzenie do ekonometrii w przykładach i zadaniach, PWN, Warszawa 2004 • G.S. Maddala, Ekonometria. PWN Warszawa 2006 • A. Welfe Ekonometria, PWE, Warszawa 1995 • A. Welfe, W. Grabowski, Ekonometria. Zbiór zadań, PWE Warszawa, |