

EKONOMETRIA I PROGNOZOWANIE PROCESÓW EKONOMICZNYCH

Dr hab. Ireneusz Kuropka, prof. UE
Katedra Prognoz i Analiz Gospodarczych

Rok I MSU, Semestr II

Opis kursu: Podejmowanie decyzji gospodarczych wymaga znajomości relacji zachodzących między różnymi zjawiskami. Narzędziem służącym do pomiaru takich zależności są modele ekonometryczne. Celem kursu jest przekazanie słuchaczom wiedzy o metodach budowy i szacowania modeli ekonometrycznych oraz wykształcenie u słuchaczy umiejętności ich stosowania, wykształcenie umiejętności: dostrzegania sytuacji prognostycznych, sporządzenia prognoz wariantowych i interpretacji wyników obliczeń oraz oceny stopnia zaufania do prognoz.

Tematyka poszczególnych zajęć:

Wykłady:

1. Modelowanie ekonometryczne. Dobór zmiennych do modelu ekonometrycznego.
2. Ocena jakości modelu; weryfikacja merytoryczna i statystyczna. Ocena dopasowania, istotności parametrów, własności składnika losowego.
3. Praktyczne zastosowanie modeli ekonometrycznych: modele liniowe i nieliniowe.
4. Podstawowe pojęcia prognostyczne: przewidywanie, prognozowanie, prognoza. Dopuszczalność prognozy. Podstawy prognozowania. Procedura budowy prognoz. Etapy prognozowania.
5. Modele szeregów czasowych. Prognozowanie na podstawie modeli tendencji rozwojowej. Prognozowanie zjawisk z wahaniami sezonowymi: metoda wskaźników.
6. Prognozowanie z wykorzystaniem modeli ekonometrycznych. Założenia prognostyczne.
7. Modele autoregresyjne i wielorównaniowe. Zmienne jakościowe w modelach ekonometrycznych.

Laboratorium:

1. Badanie zależności między cechami. Dobór zmiennych do modelu.
2. Szacowanie parametrów modelu. Weryfikacja merytoryczna i statystyczna modelu.
3. Budowa modeli nieliniowych.
4. Prognozowanie na podstawie analitycznych modeli trendu.
5. Prognozowanie zjawisk z wahaniami sezonowymi.
6. Prognozowanie na podstawie liniowego modelu ekonometrycznego.
7. Prognozowanie na podstawie modelu ekonometrycznego ze zmiennymi jakościowymi.
8. Zaliczenie.

Literatura podstawowa:

1. Ekonometria. Metody, przykłady, zadania. Red. J. Dziechciarz. Wrocław. AE 2002.
2. Strahl D., Sobczak E., Markowska M., Bal-Domańska B. Modelowanie ekonometryczne z excelelem. Wrocław AE 2002
3. Prognozowanie gospodarcze. Metody i zastosowanie. Red. M. Cieślak. Warszawa, PWN 2005.

Literatura uzupełniająca:

1. Dittmann P., Prognozowanie w przedsiębiorstwie. Wolters Kluwer Polska, Kraków 2006.
2. Metody prognozowania. Zbiór zadań. Red. B. Radzikowska. AE Wrocław 2001.
3. Ekonometria. Metody i analiza problemów ekonomicznych. Red. K. Jajuga. Wrocław. AE 1998.

Wymagania wstępne:

- znajomość statystyki, obsługi komputera, programu Excel.

Efekty kształcenia:

- nabycie umiejętności: formułowania hipotez badawczych, dotyczących mechanizmu zmian zmiennych ekonomicznych z wykorzystaniem posiadanej wiedzy, konstruowania (z zastosowaniem arkusza kalkulacyjnego) oraz oceny i interpretacji parametrów modeli opisujących zjawiska ekonomiczne, dostrzegania sytuacji prognostycznych, wyboru metody prognozowania oraz sporządzenia prognoz, interpretacji wyników obliczeń oraz oceny stopnia zaufania do prognoz.

Forma kursu:

- wykład, laboratoria komputerowe.

Liczba godzin w semestrze:

- wykład – 14 godz.,

- laboratoria komputerowe – 16 godz.

Liczba miejsc:

- bez ograniczeń.

Forma zaliczenia

- kolokwium, egzamin pisemny.