



Przedmiot: Ekonometria				
Forma zajęć: wykład	Semestr: 6	Rok: 3	Wymiar godzin: 30	Punkty ECTS: 9
Forma zaliczenia: egzamin	Typ przedmiotu: obowiązkowy		Język nauczania: polski	
Kierunek: Finanse i Bankowość		Tryb: niestacjonarne wieczorowe		Rodzaj: jednolite magisterskie
Specjalność: FIRS, FIRSP, PIDF				
Katedra: Ekonometrii				
Stopień naukowy wykładowcy: dr		Imię i nazwisko wykładowcy: Czesław Szmigiel		

Wymagania wstępne (przedmioty wprowadzające):

matematyka i statystyka

Program przedmiotu:

1. Wstępne zagadnienia Ekonometrii. Analiza linii regresji II rodzaju, para linii regresji, współczynnik korelacji liowej Pearsona
2. Metody doboru zmiennych objaśniających: analiza macierzy i wektora korelacji, współczynnik korelacji wielorakiej, metoda pojemności nośników informacji
3. Metody doboru zmiennych objaśniających: metoda grafowa, metoda analizy współczynników korelacji
4. Szacowanie modelu liniowego z wieloma zmiennymi objaśniającymi: klasyczna metoda najmniejszych kwadratów
5. Weryfikacja modelu oszacowanego KMNK: współczynniki determinacji i zbieżności, test Studenta, Test Fischera, badanie losowości składnika losowego - test liczby serii
6. Weryfikacja modelu oszacowanego KMNK: normalność rozkładu składnika losowego - testy Hellwiga i Durbin-Watsona
7. Transformacja liniowa
8. Funkcje trendu
9. Modele wielorównaniowe: klasyfikacja zmiennych, klasyfikacja modeli ekonometrycznych, estymacja modeli prostych i rekurencyjnych
10. Modele wielorównaniowe: identyfikowalność równań, estymacja modeli o równaniach łącznie współzależnych
11. Zastosowanie modelowania ekonometrycznego: funkcja produkcji
12. Zastosowanie modelowania ekonometrycznego: funkcja kosztów
13. Zastosowanie modelowania ekonometrycznego: funkcja popytu
14. Wielowymiarowa analiza porównawcza: metody porządkowania liniowego
15. Wielowymiarowa analiza porównawcza: metody klasyfikacji

Metody dydaktyczne:

Na wykładach omawiane są teoretyczne problemy modelowania ekonometrycznego i wielowymiarowej analizy porównawczej.

Cele przedmiotu:

Poznanie teoretycznych aspektów modelowania ekonometrycznego i wielowymiarowej analizy porównawczej oraz aspektów praktycznych ekonometrii

Warunki zaliczenia:

egzamin pisemny

Literatura podstawowa (do 4 pozycji):

1. Ekonometria. Metody, przykłady, zadania. Red. Józef Dziechciarz. Wydawnictwo AE, Wrocław 2002
2. Wprowadzenie do ekonometrii w przykładach i zadaniach. Red. K. Kukuła. PWN, Warszawa 1996.
3. Analiza danych marketingowych. Red. A. Stanimir. Wydawnictwo AE Wrocław, 2006;
4. G. S. Maddala: Ekonometria. Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2006.

Literatura uzupełniająca (do 4 pozycji):

--