



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

**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 objaśnjącymi: 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):**

--