

Nazwa przedmiotu:	EKONOMETRIA			
Forma: Laboratorium	Godzin: 20 Semestr: 4 Rok: 2	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS	
Wydział: ZIF	Kierunek: Informatyka i Ekonometria	Tryb: stacjonarny Rodzaj: licencjackie		
Specjalność:				
Tytuł, stopień	Imię i nazwisko lub nazwa katedry	e-mail	telefon	Pok/bud
mgr	Anna Król	anna.krol@ue.wroc.pl	0713680478	313/Z

1. Wymagania wstępne

Matematyka, Statystyka, Statystyka Matematyczna, Rachunek Prawdopodobieństwa

2. Program przedmiotu

Model regresji prostej: szacowanie parametrów, obliczanie błędów ocen, interpretacja. Model regresji wielorakiej: szacowanie parametrów, obliczanie błędów ocen, interpretacja. Współczynnik korelacji liniowej Pearsona, współczynnik korelacji wielorakiej. Testy istotności parametrów oparte na statystyce t-Studenta i F-Snedecora. Przedziały ufności dla parametrów. Współczynnik determinacji. Problem specyfikacji modelu regresji: zmienne pominięte, zmienne nieistotne, kryteria informacyjne (AIC, BIC), test RESET, test F dla wielu ograniczeń liniowych, metoda Hellwiga, metoda grafowa, metoda analizy współczynników korelacji. Wybrane nieliniowe modele regresji.

3. Metodyka zajęć

Rozwiązywanie praktycznych zadań i problemów z wykorzystaniem programów MS Excel oraz gretl. Studia przypadków. Przygotowanie i zaprezentowanie modelu ekonometrycznego utworzonego na podstawie własnych badań.

4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: teoretyczne podstawy modelowania ekonometrycznego

Umiejętności: zastosowanie metod modelowania ekonometrycznego w mikroekonomii, makroekonomii i finansach, wykorzystanie programów MS Excel oraz gretl w modelowaniu ekonometrycznym

Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

- Maddala G.S.: Ekonometria. Warszawa: Wydawnictwo Naukowe PWN, 20062. Błalock H. Statystyka dla socjologów. Warszawa PWN 1977
- Dziechciarz J. (red.): Ekonometria - metody, przykłady, zadania. Wrocław: Wyd. AE, 2003
- Theil H.: Zasady ekonometrii, Warszawa: PWN, 1979
- Gajda J.: Ekonometria. Warszawa: C.H. Beck, 2004

Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

- Charemza W., Deadman D.: Nowa ekonometria, Warszawa: PWE, 1997
- Strahl D.: Modelowanie ekonometryczne z Excelem. Wrocław: Wydawnictwo AE, 2004
- Chow G.: Ekonometria. Warszawa: PWN, 1995
- Welfe A.: Ekonometria. Warszawa: PWE, 2003