

Nazwa przedmiotu:	<b>EKONOMETRIA</b>			
Forma: Ćwiczenia	Godzin: 15 Semestr: 5 Rok: 3	Forma zaliczenie: zal. na ocenę	ECTS	
Wydział: ZIF	Kierunek: Informatyka i Ekonometria	Tryb: stacjonarny Rodzaj: licencjackie		
Specjalność: Analiza Danych1, E-biznes1, Ekonometria Menedżerska1, Usługi Informatyczne1				
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

Weryfikacja założeń modelu regresji: heteroskedastyczność składnika losowego, autokorelacja składnika losowego, normalność rozkładu składnika losowego, losowość. Uogólniona metoda najmniejszych kwadratów. Modele wielorównaniowe: klasyfikacja zmiennych, klasyfikacja modeli, PMNK, 2MNK. Modele dyskretnych zmiennych zależnych: liniowy model prawdopodobieństwa, model logitowy i model probitowy. Wprowadzenie do analizy szeregów czasowych: stacjonarność, integracja, testy pierwiastka jednostkowego, kointegracja, modele korekty błędem (ECM).

### 3. Metodyka zajęć

Rozwiązywanie praktycznych i teoretycznych zadań i problemów. Studia przypadków.

### 4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: teoretyczne podstawy modelowania ekonometrycznego

Umiejętności: zastosowanie metod modelowania ekonometrycznego w mikroekonomii, makroekonomii i finansach

### Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

1. Maddala G.S.: Ekonometria. Warszawa: Wydawnictwo Naukowe PWN, 20062. Białock H. Statystyka dla socjologów. Warszawa PWN 1977
2. Dziechciarz J. (red.): Ekonometria - metody, przykłady, zadania. Wrocław: Wyd. AE, 2003
3. Nowak E.: Zarys metod ekonometrii. Warszawa: PWN, 2002
4. Theil H.: Zasady ekonometrii, Warszawa: PWN, 1979
5. Gajda J.: Ekonometria. Warszawa: C.H. Beck, 2004

### Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

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