

Nazwa przedmiotu:	<b>EKONOMETRIA</b>			
Forma: Wykład	Godzin: 15 Semestr: 5 Rok: 3	Forma zaliczenie: egzamin	ECTS 4	
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
prof. dr hab.	Katedra Ekonometrii	ekonometria@ue.wroc.pl	713680339	Z-309

### 1. Wymagania wstępne

Statystyka

### 2. Program przedmiotu

Regresja I i II rodzaju, współczynnik korelacji. Macierz korelacyjna i współczynnik korelacji wielorakiej. Dobór zmiennych objaśniających do modelu metodą analizy współczynników korelacji, metodą pojemności informacji oraz metodą grafową. Założenia standardowego modelu liniowego. Estymacja parametrów modelu liniowego metodą najmniejszych kwadratów (MNK). Twierdzenie Gaussa-Markowa (wraz z dowodem) i własności estymatora MNK. Transformacja liniowa. Wybrane metody uzyskiwania estymatorów dla modeli transformowanych. Miary dopasowania modelu do danych empirycznych. Istotność parametrów strukturalnych modelu liniowego (test Studenta oraz test F).

### 3. Metodyka zajęć

Przekazywane wiadomości w formie wykładu, omawianie wybranych przykładów praktycznych.

### 4. Cel dydaktyczny przedmiotu

Wiadomości: budowa jednorównaniowych modeli regresji, estymacją parametrów za pomocą MNK, własności teoretyczne estymatora;  
Umiejętności: podstawy konstruowania jednorównaniowych modeli regresji.

#### Wykaz literatury podstawowej (do 4 pozycji)

Maddala G.S.: Ekonometria. Warszawa: Wydawnictwo Naukowe PWN, 2006.  
Dziechciarz J. (red.): Ekonometria - metody, przykłady, zadania. Wrocław: Wyd. AE, 2003.  
Theil H.: Zasady ekonometrii, Warszawa: PWN, 1979.  
Gruszczyński M., Podgórska M. (red.): Ekonometria. Warszawa: SGH, 2003.

#### Wykaz literatury uzupełniającej (do 4 pozycji)

Greene W.: Econometric Analysis. Upper Saddle River: Prentice Hall, 2003.  
Gajda J.: Ekonometria. Warszawa: C.H. Beck, 2004.  
Welfe A.: Ekonometria. Warszawa: PWE, 2003.  
Chow G.: Ekonometria. Warszawa: PWN, 1995.