

Elementy składowe sylabusu	Opis
Nazwa przedmiotu	ekonometria
Kod przedmiotu	
Nazwa kierunku	matematyka, specjalność matematyka finansowa
Nazwa jednostki prowadzącej kierunek	Wydział Matematyki i Informatyki, Instytut Matematyki
Język przedmiotu	język polski
Charakterystyka przedmiotu	treści kierunkowe, przedmiot jest obowiązkowy
Rok studiów/semestr	rok studiów III/semestr piąty
Liczba godzin zajęć dydaktycznych oraz forma prowadzenia zajęć	45 godzin ćwiczeń
Punkty ETCS	8
Prowadzący	mgr Robert Jankowski, mgr Urszula Ostaszewska
Założenia i cele przedmiotu	Umiejętność budowy, estymacji, interpretacji oraz zastosowania podstawowych opisowych modeli ekonometrycznych jednorównaniowych i wielorównaniowych
Wymagania wstępne	algebra, analiza matematyczna, statystyka
Treści merytoryczne przedmiotu	<p>Zagadnienia wstępne.</p> <p>Model ekonometryczny: elementy modelu, klasyfikacja zmiennych w modelu, klasyfikacja modeli ekonometrycznych.</p> <p>Etapy analizy ekonometrycznej.</p> <p>Dobór zmiennych objaśniających do jednorównaniowego modelu ekonometrycznego.</p> <p>Wybór postaci analitycznej modelu.</p> <p>Klasyczna metoda najmniejszych kwadratów: założenia metody, szacowanie parametrów strukturalnych modelu, parametry struktury stochastycznej modelu, twierdzenie Gaussa-Markowa.</p> <p>Estymacja przedziałowa parametrów strukturalnych modelu.</p> <p>Weryfikacja liniowego modelu ekonometrycznego: dopasowanie modelu do danych empirycznych, istotność parametrów strukturalnych, badanie własności rozkładu składnika losowego (normalność, autokorelacja, homoskedastyczność).</p> <p>Szacowanie parametrów modeli ekonometrycznych z autokorelacją lub heteroskedastycznością.</p> <p>Zmienne jakościowe w modelach ekonometrycznych.</p> <p>Modele nieliniowe.</p> <p>Prognozowanie na podstawie jednorównaniowych modeli ekonometrycznych.</p> <p>Modele wielorównaniowe: postać strukturalna i zredukowana modelu, klasyfikacja modeli wielorównaniowych, szacowanie parametrów modeli prostych i rekurencyjnych, identyfikowalność modeli o równaniach łącznie współzależnych, estymacja parametrów modeli o równaniach łącznie współzależnych.</p> <p>Funkcja produkcji.</p> <p>Elementy wielowymiarowej analizy porównawczej.</p>
Forma i warunki zaliczenia przedmiotu	<p>dwa kolokwia, każde 50 punktów, warunkiem zaliczenia ćwiczeń jest uzyskanie połowy punktów z sumy punktów za oba kolokwia.</p> <p>skala ocen:</p> <p>0% - 50% - ocena niedostateczna</p> <p>51% - 60% - ocena dostateczna</p> <p>61% - 70% - ocena dostateczna plus</p> <p>71% - 80% - ocena dobra</p> <p>81% - 90% - ocena dobra plus</p> <p>91% - 100% - ocena bardzo dobra</p>
Wykaz literatury podstawowej i uzupełniającej	<p>Literatura podstawowa:</p> <p>Chow G.C.: <i>Ekonometria</i>, PWN, Warszawa 1995.</p> <p>Gruszczyński M., Kuszewski T., Podgórska M.: <i>Ekonometria i badania operacyjne</i>, PWN, Warszawa 2009.</p> <p>Jajuga K. (i in.): <i>Ekonometria. Metody i analiza problemów ekonomicznych</i> Wydawnictwo AE we Wrocławiu, Wrocław 1998.</p> <p>Maddala G.S.: <i>Ekonometria</i>, PWN, Warszawa 2006.</p> <p>Welfe A.: <i>Ekonometria</i>, PWE, Warszawa 2003.</p> <p>Literatura uzupełniająca:</p> <p>Bartosiewicz S. (i in.): <i>Metody ekonometryczne. Przykłady i zadania</i>, PWE, Warszawa 1974.</p>

	Borkowski B., Dudek H., Szczęsny W.: <i>Ekonometria. Wybrane zagadnienia</i> , PWN, Warszawa 2003. Kukuła K. (i in.): <i>Wprowadzenie do ekonometrii</i> , PWN, Warszawa 2009. Strahl D. (i in.): <i>Modelowanie ekonometryczne z Excelem</i> , Wydawnictwo AE we Wrocławiu, Wrocław 2004.
--	--

.....
podpis osoby składającej sylabus