

## Sylabus przedmiotu

Przedmiot:	<b>Ekonometria II</b>
Kierunek:	Ekonomia, II stopień [4 sem], stacjonarny, ogólnoakademicki, rozpoczęty w: 2013
Rok/Semestr:	I/2
Liczba godzin:	15,0
Nauczyciel:	<b>Wroński Paweł, dr</b>
Forma zajęć:	konwersatorium
Rodzaj zaliczenia:	zaliczenie na ocenę
Poziom trudności:	wszystkie poziomy
Wstępne wymagania:	zaliczenie przedmiotów: statystyka, ekonometria I, mikro- i makroekonomia, marketing, rachunkowość, ekonomika przedsiębiorstwa
Metody dydaktyczne:	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ćwiczenia laboratoryjne</li> <li>• opis</li> <li>• z użyciem komputera</li> </ul>
Zakres tematów:	<p>Ekonometria, przedmiot badań i miejsce wśród dyscyplin naukowych (historia powstania ekonometrii jako dyscypliny naukowej, przedmiot badań, ekonometrycznych, zastosowanie ekonometrii w gospodarce). Model ekonometryczny: pojęcie modelu ekonometrycznego (model jako narzędzie badawcze, klasyfikacja modeli ekonometrycznych), etapy budowy modelu ekonometrycznego. Estymacja parametrów modelu ekonometrycznego za pomocą KMNK (klasycznej metody najmniejszych kwadratów). Dobór zmiennych do modelu – ustalanie postaci analitycznej modelu. Wybrane modele nieliniowe – zastosowania w badaniach ekonomicznych. Ocena jakości modelu ekonometrycznego.</p> <p>Wielorównaniowe modele ekonometryczne: charakterystyka modeli wielorównaniowych, postać strukturalna i zredukowana wielorównaniowego modelu ekonometrycznego, klasyfikacja modeli wielorównaniowych, estymacja modeli prostych i rekurencyjnych, estymacja modelu o równaniach współzależnych, identyfikacja modeli wielorównaniowych, pośrednia metoda najmniejszych kwadratów, podwójna metoda najmniejszych kwadratów. Prognozowanie ekonometryczne. Mierniki jakości prognozy ekonometrycznej. Prognozowanie na podstawie szeregów czasowych. Modelowanie i prognozowanie zjawisk sezonowych. Modele wielorównaniowe. Modelowanie i prognozowanie zmiennych jakościowych.</p> <p>Podstawowe problemy procesu podejmowania decyzji: konstrukcja matematycznego modelu decyzyjnego, typowe mikroekonomiczne sytuacje decyzyjne (wybór asortymentu produkcji, problem diety-mieszanek, wybór procesów technologicznych). Metody rozwiązywania liniowych modeli decyzyjnych: metoda graficzna (sposoby dochodzenia do rozwiązania optymalnego, wrażliwość rozwiązania optymalnego na zmiany cen (kosztów) oraz zmiany warunków ograniczających), metoda simpleks (istota metody simpleks, kryterium optymalności w metodzie simpleks, alternatywne rozwiązania w metodzie simpleks, analiza wrażliwości (pooptymalizacyjna). Dualizm w programowaniu liniowym. Elementy logistyki w programowaniu liniowym: zagadnienia transportowe (zamknięte zagadnienie transportowe, otwarte zagadnienie transportowe, zagadnienie transportowo-produkcyjne, problem lokalizacji produkcji, metody wyznaczania wyjściowego rozwiązania bazowego - metoda kąta północno-zachodniego, metoda minimum w wierszu, metoda minimum w kolumnie, metoda minimalnego elementu w macierzy. Metoda potencjałów (Danziga) jako sposób wyznaczania optymalnego rozwiązania bazowego. Model przepływów międzydziałowych.</p>
Forma oceniania:	<ul style="list-style-type: none"> <li>• ocena ciągła (bieżące przygotowanie do zajęć i aktywność)</li> </ul>
Warunki zaliczenia:	Uczestnictwo w zajęciach
Literatura:	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. <i>Badania operacyjne w przykładach i zadaniach</i>, pod red. Karola Kukuły, Wydawnictwo Naukowe PWN</li> <li>2. <i>Ekonometria</i>, pod red. Gruszczyńskiego M., Podgórskiej M., SGH, Warszawa</li> <li>3. Nowak Edward, <i>Elementy badań operacyjnych</i>, Wydawnictwo UMCS, Lublin</li> <li>4. <i>Ekonometria. Metody, przykłady, zadania</i>, pod red. J. Dziechciarza, Wydawnictwo AE we Wrocławiu, Wrocław</li> <li>5. Chow G.C., <i>Ekonometria</i>, PWN, Warszawa</li> <li>6. Welfe A., <i>Ekonometria. Metody i zastosowania</i>, PWE, Warszawa</li> </ol>