

CVIČENIA Z EKONOMETRIE, LS 2005/2006

Beáta Stehlíková

KAMŠ, M266

e-mail: stehlikova@pc2.iam.fmph.uniba.sk

www: <http://www.iam.fmph.uniba.sk/institute/stehlikova/em06>

O ekonometrii:

Within the group of economists I think I should speak a special word in the name of those who are calling themselves econometricians, those who apply mathematics and statistics together with economics in order to verify economic theories and therefore, as we think, to contribute to making scientific work possible at a higher stage in economics.

Jan Tinbergen (1903-1994), jeden z prvých dvoch nositeľov Ceny Švédskej banky za ekonomiu, 1969

<http://nobelprize.org/economics/laureates/1969>

Cvičenia:

- Opakovanie: popis dát, pravdepodobnostné rozdelenia, odhady, testovanie hypotéz
- Lineárny regresný model:
 - Model s klasickými predpokladmi: odhady parametrov, testy o parametroch
 - Ako overiť, či sú tieto predpoklady splnené?
 - Čo robiť, ak zistíme, že splnené nie sú?
- Teoretické úlohy aj analýza modelov a reálnych dát

Body: 0-30 bodov na skúšku

- Domáce úlohy (15 bodov): každý týždeň domáca úloha za 15 bodov + prípadné prémie body
- Písomky (15 bodov): budeme písať dve písomky (v polovici a na konci semestra), každá bude za 15 bodov + prípadné prémie body

Body na skúšku: $\min\{30, \text{priemer bodov z DÚ} + \text{priemer bodov z písomiiek}\}$

Softvér:

Vo viacerých domácich úlohách budete programovať alebo počítať odhady modelov a testy na zadaných dátach. Môžete pritom používať ľubovoľný softvér (MATLAB, Splus, R, EViews, ...).

Väčšina výsledkov, ktoré budeme používať na cvičeniach, bude získaná použitím MATLABu (programovanie) a EViews (ekonometrické modely). Programy v MATLABe budú na webovej stránke, dáta použité v modeloch budú na stránke v textovom formáte, takže ich môžete načítať do softvéru, ktorý používate.