

CVIČENIA Z EKONOMETRIE  
LETNÝ SEMESTER 2007/2008

Beáta Stehlíková

KAMŠ, M266

E-mail: stehlikova@pc2.iam.fmph.uniba.sk, domáce úlohy: bs.ulohy@gmail.com

Web: <http://www.iam.fmph.uniba.sk/institute/stehlikova/em08>

**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 ekonómiu  
<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 (EViews, MATLAB, R, ...).

Väčšina výsledkov, ktoré budeme používať na cvičeniach, bude získaná použitím programu EViews a bude potrebné vedieť sa orientovať vo výstupoch a vedieť ich interpretovať. Použité dáta budú na stránke v textovom formáte, takže ich môžete načítať do softvéru, ktorý používate.

**Projekt:**

Počas semestra vypracujete projekt, ktorého obsahom bude ekonometrická analýza zvoleného modelu. Podrobnejšie informácie budú uvedené neskôr, približne na konci prvého mesiaca semestra. Za projekt je možné získať maximálne 20 bodov.