

INFORMAČNÝ LIST PREDMETU

Vysoká škola: Univerzita Komenského v Bratislave	
Fakulta: Fakulta matematiky, fyziky a informatiky	
Kód predmetu: FMFI.KAMŠ/1-EFM-380/00	Názov predmetu: Ekonometria
Druh, rozsah a metóda vzdelávacích činností: Forma výučby: prednáška / cvičenie Odporúčaný rozsah výučby (v hodinách): Týždenný: 2 / 2 Za obdobie štúdia: 28 / 28 Metóda štúdia: prezenčná	
Počet kreditov: 5	
Odporúčaný semester/trimester štúdia: 2., 6.	
Stupeň štúdia: I., II.	
Podmieňujúce predmety: FMFI.KAMŠ/1-EFM-330/00 - Štatistické metódy alebo FMFI.KAMŠ/2-MMN-106/00 - Počítačová štatistika alebo FMFI.KAMŠ/2-PMS-107/00 - Regresné modely (1) alebo FMFI.KAMŠ/2-PMS-107/15 - Regresné modely (1) alebo FMFI.KAMŠ/2-MMN-106/15 - Počítačová štatistika	
Odporúčané prerekvizity (nepovinné): Odporúčaná prerekvizita pre študentov mPMS (namiesto podmieňujúcej, ktorú majú ostatní): 2-PMS-105 Viacrozmerné štatistické analýzy (1)	
Podmienky na absolvovanie predmetu: Priebežné hodnotenie: projekt na reálnych dátach Skúška: písomná skúška Orientačná stupnica hodnotenia: A 90%, B 80%, C 70%, D 60%, E 50% Váha priebežného / záverečného hodnotenia: 30/70	
Výsledky vzdelávania: Študenti budú schopní vykonať štandardné regresné analýzy a použiť ich v ekonomickej praxi. Taktiež získajú teoretické znalosti o matematickom aparáte na pozadí týchto metód, čo je nutným predpokladom pre ďalšie štúdium v oblasti.	
Stručná osnova predmetu: Lineárna regresia, jej geometria a LS-odhady parametrov. Rozklad sumy štvorcov, koeficienty determinácie a Akaikého informačné kritérium. Vlastnosti odhadov parametrov a disperzie chýb. Gauss-Markovova veta. Testy o lineárnych kombináciách parametrov. Model s obmedzeniami na parametre. Chyby pri špecifikácii modelu a ich odhaľovanie. Dummy-premenné. ML-prístup v lineárnej regresii (LRT, Waldov test, score test). GLS-odhady v lineárnej regresii. Heteroskedasticita. Autokorelácia.	
Odporúčaná literatúra: Econometric methods / Jack Johnston, John DiNardo. New York : McGraw Hill, 1997 Karel Zvara: Regrese (dostupné online: http://www.mff.cuni.cz/fakulta/mfp/download/books/zvara_-_regrese.pdf)	
Jazyk, ktorého znalosť je potrebná na absolvovanie predmetu: slovenský, anglický	

Poznámky:					
Hodnotenie predmetov Celkový počet hodnotených študentov: 783					
A	B	C	D	E	FX
25,54	15,96	19,54	16,6	19,16	3,19
Vyučujúci: Mgr. Ján Somorčík, PhD., Mgr. Katarína Burclová, Mgr. Michaela Koščová					
Dátum poslednej zmeny: 02.06.2015					
Schválil: prof. RNDr. Michal Fečkan, DrSc., prof. RNDr. Marek Fila, DrSc., doc. RNDr. Margaréta Halická, CSc.					