

1. Uvod v ekonometrijo

prof. dr. Miroslav Verbič

miroslav.verbic@ef.uni-lj.si

www.miroslav-verbic.si



Ljubljana, februar 2024

Definicija ekonometrije

EKONOMETRIJA  **ECONOMETRICS**

“Zveza med matematiko, statistiko in ekonomijo; opravka imamo z novo disciplino, ki jo ob pomanjkanju boljšega imena lahko poimenujemo **ekonometrija**. Cilj ekonometrije je soočiti abstraktne zakone teoretične politične ekonomije oziroma “čiste” ekonomije z eksperimentalno in numerično verifikacijo ter s tem spremeniti čisto ekonomijo, kolikor je to mogoče, v znanost v striktnem pomenu besede.”

Ragnar Frisch, 1926. leta

Definicija ekonometrije

Ragnar Frisch (1895 – 1973)

Dobitnik prve Nobelove nagrade za ekonomijo,
skupaj z J. Tinbergenom leta 1969



Definicija ekonometrije

ECONOMETRICS

OIKOS	NOMOS	METRON
HIŠA, GOSPODARSTVO	NAUK, VEDA	MERA AAA

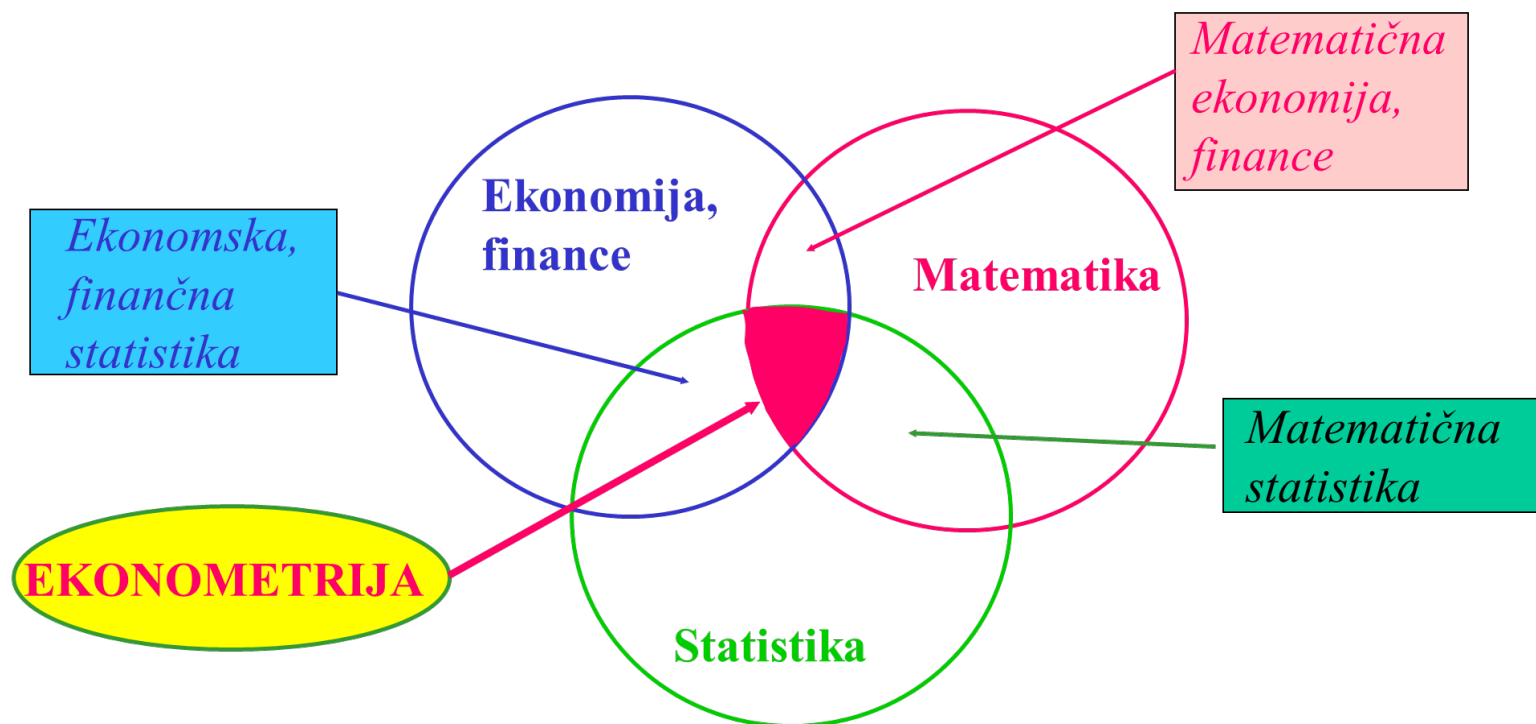
“Veda o merjenju povezav med ekonomskimi spremenljivkami.”

29. decembra 1930 je v Clevelandu šestnajstim
najvidnejšim ekonomistom predsedoval Joseph Schumpeter.
Ustanovili so **Econometric Society**.

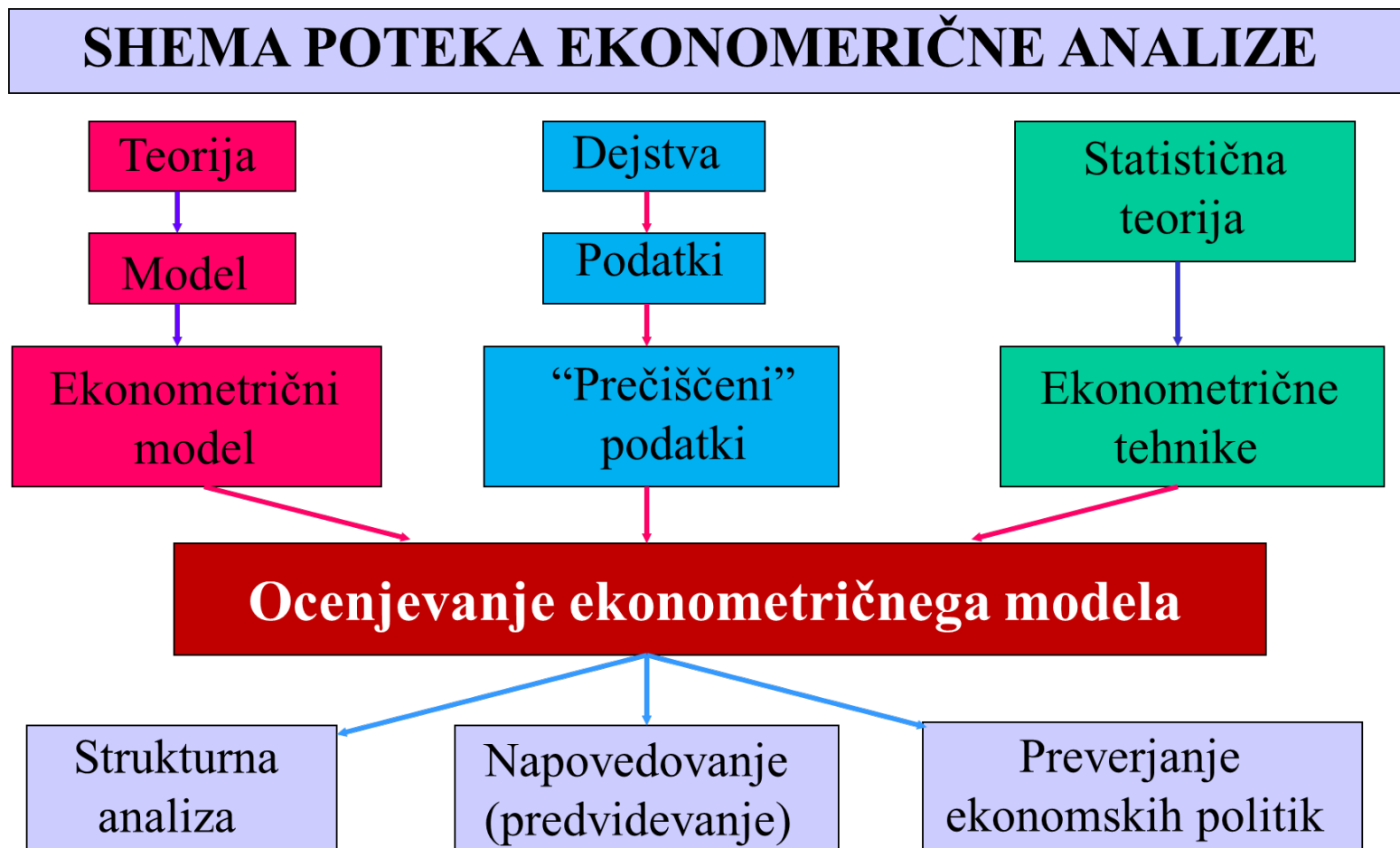


1933. leta izide prvi zvezek revije Econometrica

Definicija ekonometrije



Potek ekonometrične analize



Lastnosti ekonometričnega modela

Christ (1966) omenja šest željenih lastnosti, ki naj bi jih imel ekonometrični model:

1. **Relevantnost** – model naj bi obravnaval pomemben in zanimiv problem in naj ne bi služil zgolj intelektualnemu zadovoljstvu.
2. **Preprostost** – model naj bi predstavljal ekonomske povezave v najbolj preprosti možni obliki (varčnost, parsimoničnost). Njegov pomen mora biti razumljiv, tako da omogoča logične in analitične operacije.
3. **Teoretična sprejemljivost** – specifikacija modela naj bi bila v skladu z domnevami (postulati) ekonomske ali finančne teorije.

Lastnosti ekonometričnega modela

4. **Pojasnjevalna moč** – model naj bi bil sposoben v čimvečji meri razložiti dejanska dogajanja. Naj bi bil v skladu z opazovanimi gibanji ekonomskih ali finančnih spremenljivk, ki so vključene v model.
5. **Zanesljivost ocenjenih koeficientov** – ocene koeficientov modela naj bi bile čimbolj natančne. Ocene naj bi imele željene statistične lastnosti, kot so nepristranskost, konsistentnost (doslednost) in učinkovitost.
6. **Napovedna moč** – na podlagi ocenjenega modela naj bi bilo možno pripraviti zadovoljiva predvidevanja oziroma napovedi vrednosti odvisnih (endogenih) spremenljivk pri danih vrednostih pojasnjevalnih (ekosogenih) spremenljivk.

M. Friedman: “Pojasni veliko s čim manj.”

1. Uvod v ekonometrijo

prof. dr. Miroslav Verbič

miroslav.verbic@ef.uni-lj.si

www.miroslav-verbic.si



Ljubljana, februar 2024