

Ekonometria Dynamiczna

Informacje Organizacyjne

mgr Paweł Jamer¹

4 kwietnia 2015

¹pawel.jamer@gmail.com

Wymagania wstępne

Wymagania wstępne:

- podstawy programowania (r-language),
- rachunek prawdopodobieństwa,
- statystyka matematyczna.

Zakres materiału

- ❶ Szeregi czasowe: podstawowe definicje i miary.
- ❷ Model liniowy jako narzędzie analizy szeregów czasowych.
- ❸ Badanie stacjonarności szeregów czasowych.
- ❹ Wybrane modele jednowymiarowych szeregów czasowych.
 - ❶ Model ARMA.
 - ❷ Pochodne modelu ARMA.
 - ❸ Modele z rozkładami opóźnień.
- ❺ Analiza kointegracji.
- ❻ Wybrane modele wielowymiarowych szeregów czasowych.
 - ❶ Model VAR.
 - ❷ Model VECM.
- ❼ Modelowanie niestacjonarności.
 - ❶ Modele ARCH i GARCH.

Zaliczenie (punkty)

❶ Teoria (25 punktów):

❶ kartkówki (10 punktów):

- na początku każdych zajęć,
- obowiązuje materiał z zajęć poprzednich,

❷ egzamin teoretyczny (15 punktów):

- część egzaminu końcowego,
- pytania otwarte z całego materiału teoretycznego.

❷ Praktyka (75 punktów):

❶ zadania domowe (30 punktów):

- podawane na koniec każdych zajęć,
- czas na oddanie to średnio 7 dni roboczych,

❷ egzamin praktyczny (45 punktów):

- część egzaminu końcowego,
- zadania rozwiązywane na komputerach.

❸ Szeroko pojęta aktywność:

- ❶ zadania dodatkowe, projekty, prezentacje,
- ❷ inwencja własna.

Zaliczenie (ocena końcowa)

Ocena końcowa:

- **5.0** → od **91** punktów,
- **4.5** → od **81** do **90** punktów,
- **4.0** → od **71** do **80** punktów,
- **3.5** → od **61** do **70** punktów,
- **3.0** → od **51** do **60** punktów.

Warunki dodatkowe:

- minimum 51 punktów z części formalnej (teoria + praktyka).

- ❶ Iwanik A., Misiewicz J. K.; Wykłady z procesów stochastycznych z zadaniami. Część pierwsza: Procesy Markowa; Script, Warszawa 2010.
- ❷ Maddala G. S.; Ekonometria; PWN, Warszawa 2008.
- ❸ Walesiak M., Gatnar E., Statystyczna analiza danych z wykorzystaniem programu R, PWN 2009.
- ❹ Biecek P., Przewodnik po pakiecie R, Oficyna Wydawnicza GiS, Wrocław 2008.
- ❺ ...
- ❻ ...
- ❼ ...

<http://jamer.webd.pl>