

## KARTA PRZEDMIOTU

Analityka Gospodarcza

Nazwa przedmiotu	Ekonometria dynamiczna			
Język prowadzenia przedmiotu	polski			
Kod/Specjalność	Analityka mikroekonomiczna Analityka makroekonomiczna Analityka instytucji finansowych i ubezpieczeń			
Kategoria przedmiotu	kierunkowe lub ogólne			
Profil studiów	ogólnoakademicki			
Poziom PRK	7			
Rok studiów/semestr	1/1			
Forma zajęć/liczba godzin	Wykłady		Inne	
	Stacjonarne:	20	30	
	Niestacjonarne:	12	18	
Dyscypliny	Nazwa		Liczba punktów ECTS	
	Ekonomia i Finanse		8	
	-----		-----	
Wykładowca odpowiedzialny za przedmiot na kierunku	Justyna Wróblewska, dr			
Cele przedmiotu	Kod	Opis		
	C1	Zapoznanie studenta z metodologią, współczesnymi modelami oraz narzędziami ekonometrii dynamicznej.		
	C2	Wykształcenie umiejętności identyfikacji i estymacji wielowymiarowych modeli dynamicznych, interpretacji uzyskanych wyników, prognozy wybranych zjawisk, stosowania modeli procesów niestacjonarnych w analizie wybranych zależności makroekonomicznych, weryfikacji hipotez teorii ekonomii na podstawie danych empirycznych.		
	C3	Wskazanie kierunków i możliwości pogłębiania zdobytej wiedzy na temat analiz zależności ekonomicznych z wykorzystaniem wielowymiarowych dynamicznych modeli ekonometrycznych.		
Realizowane efekty uczenia się	Kod	Kat.	Opis	Odniesienie do efektów kierunkowych
	E1	W	Absolwent zna i rozumie w pogłębionym stopniu metody modelowania i prognozowania procesów gospodarczych. Posiada rozszerzoną wiedzę dotyczącą metod statystycznych wykorzystywanych w badaniach zjawisk i procesów gospodarczych na podstawie wielowymiarowych szeregów czasowych. Posiada wiedzę dotyczącą konstrukcji i zastosowania zaawansowanych modeli statystyczno-ekonometrycznych. Posiada rozszerzoną i pogłębioną wiedzę na temat modelowania makroekonomicznych szeregów czasowych.	AG_W02 AG_W04 AG_W05
	E2	U	Absolwent potrafi właściwie analizować przyczyny i przebieg zjawisk i procesów gospodarczych. Potrafi modelować i prognozować wybrane zjawiska i procesy gospodarcze z wykorzystaniem zaawansowanych metod statystyczno-ekonometrycznych. Potrafi stosować zaawansowane metody statystycznej analizy wielowymiarowej w badaniach zjawisk i procesów gospodarczych. Posiada umiejętność konstrukcji i stosowania zaawansowanych modeli statystyczno-ekonometrycznych. Potrafi budować i weryfikować wielowymiarowe modele szeregów czasowych. Potrafi wykorzystać statystyczno-ekonometryczne programy komputerowe do realizacji zadanych celów. Posiada umiejętność proponowania rozwiązań konkretnego problemu z wykorzystaniem zdobytej wiedzy z zakresu kierunku studiów Analityka gospodarcza. Potrafi pracować w grupie oraz przygotować makroekonometryczne badanie empiryczne.	AG_U02 AG_U03 AG_U04 AG_U08

	E4	K	Absolwent jest gotów do samodzielnego poszerzania wiedzy oraz potrafi ją realizować samodzielnie i krytycznie,	AG_K01 AG_K02
<i>Sposoby weryfikacji efektów uczenia się</i>	<i>egzamin pisemny, projekt grupowy, sprawdziany cząstkowe</i>			
<i>Treści przedmiotu</i>	<i>Kod</i>	<i>Opis</i>	<i>Liczba godzin</i>	
			<i>stacjonarne</i>	<i>niestacjonarne</i>
	W1	Przedmiot ekonometrii dynamicznej. Cele i metody badań ekonometrycznych. Procesy stochastyczne jako narzędzie modelowania szeregów czasowych.	2	2
	W2	Własności wielowymiarowych stacjonarnych procesów autoregresyjnych.	2	1
	W3	Estymacja i wykorzystanie wielowymiarowych stacjonarnych procesów autoregresyjnych.	4	2
	W4	Jedno- i wielowymiarowe procesy zintegrowane.	2	1
	W5	Pojęcie kointegracji oraz jej empiryczne znaczenie.	2	1
	W6	Model z mechanizmem korekty błędu oraz procedura Engla i Granger'a.	2	1
	W7	Postać i własności wektorowego modelu z mechanizmem korekty błędu.	2	1
	W8	Estymacja modelu VEC za pomocą procedury Johansena.	4	3
			<b>20</b>	<b>12</b>
	L1	Procesy AR, AM, VAR, VMA – własności, funkcja autokorelacji (ACF) i autokorelacji cząstkowej (PACF).	3	2
	L2	Estymacja modeli VAR (wybór liczby opóźnień, składowych deterministycznych).	2	1
	L3	Testowanie założeń modelu VAR.	3	2
	L4	Wprowadzenie do analiz strukturalnych w ramach modeli VAR.	3	1
	L5	Prognozowanie z wykorzystaniem modeli VAR.	2	1
	L6	Procesy skointegrowane – przykłady i własności.	3	2
	L7	Procedura Johansena – testowanie liczby relacji kointegrujących, estymacja modeli VEC oraz interpretacja uzyskanych wyników.	4	3
	L8	Testowanie dodatkowych restrykcji nakładanych na parametry modelu VEC.	4	1
	L9	Wykorzystanie modeli VEC w analizach strukturalnych.	4	3
	L10	Prognozowanie z wykorzystaniem modeli VEC.	2	2
			<b>30</b>	<b>18</b>
<i>Metody prowadzenia zajęć</i>	<i>wykład audytoryjny, ćwiczenia przedmiotowe, dyskusja, symulacja, analiza przypadku, ćwiczenia laboratoryjne</i>			
<i>Nakład pracy studenta (liczba godzin kontaktowych, pracy on-line i pracy samodzielnej)</i>	<i>Rodzaj aktywności</i>		<i>Liczba godzin</i>	
			<i>stacjonarne</i>	<i>niestacjonarne</i>
	<i>Udział w zajęciach dydaktycznych w bezpośrednim kontakcie z prowadzącym</i>		50	30
	<i>Udział w konsultacjach</i>		10	11
	<i>Udział w kolokwiach/egzaminie</i>		8	8
	<i>Praca własna studenta</i>		85	100
	<i>E-learning</i>		0	0
	<i>Inne</i>		47	51
	<i>Suma godzin</i>		200	200
<i>Liczba punktów ECTS</i>		8		

<i>Macierz realizacji przedmiotu</i>	<i>Przedmiot. efekt uczenia się</i>	<i>Odniesienie do efektów kierunkowych</i>	<i>Cele przedmiotu</i>	<i>Treści przedmiotu</i>	<i>Metody/narzędzia dydaktyczne</i>	<i>Sposoby weryfikacji efektu</i>
	E1	AG_W02 AG_W04 AG_W05	C1	W1, W2, W3, W4, W5, W6, L1, L2, L3, L4, L5, L6, L7, L8	wykład audytoryjny, ćwiczenia przedmiotowe, dyskusja, symulacja, analiza przypadku, ćwiczenia laboratoryjne	egzamin pisemny, projekt grupowy, sprawdziany cząstkowe
	E2	AG_U02 AG_U03 AG_U04 AG_U08	C1, C2	W2, W3, W4, W5, W6, L1, L2, L3, L4, L5, L6, L7, L8		
	E4	AG_K01 AG_K02	C3	W1, W2, W3, W4, W5, W6, L1, L2, L3, L4, L5, L6, L7, L8		
<i>Literatura podstawowa</i>	Charemza W.W., Deadman D.F., (1997), Nowa ekonometria, PWE, Warszawa. Kusidel E., (2000), Modele wektorowo-autoregresyje VAR: metodologia i zastosowania, Absolwent, Łódź Welfe A. (red.), (2013), Analiza kointegracyjna w makromodelowaniu, PWE, Warszawa					
<i>Literatura uzupełniająca</i>	Lütkepohl H., (2007), New Introduction to Multiple Time Series Analysis, Springer-Verlag, Berlin. Juselius K., (2006), The cointegrated VAR model. Methodology and applications, Oxford					
<i>Forma i warunki zaliczenia przedmiotu</i>	Ocena bieżąca jest średnią ważoną ocen cząstkowych. Ocena końcowa z przedmiotu jest średnią ważoną: średniej z ocen bieżących oraz wszystkich ocen z egzaminu – pod warunkiem, że średnia z ocen bieżących oraz jedna z ocen z egzaminu są pozytywne. Wagi są takie same, jednak zależą od liczby podejść do egzaminu. Jeżeli student zaliczył egzamin w pierwszym terminie, to są one równe 1/2, a średnią ważoną w razie potrzeby zaokrągla się do najbliższej liczby całkowitej. Jeśli student zdał egzamin w II terminie, to wagi są równe 1/3, a średnią ważoną w razie potrzeby zaokrągla się do najbliższej połówki. Nieusprawiedliwiona nieobecność studenta na określonym terminie egzaminu jest równoważna z oceną niedostateczną, która jest uwzględniana przy obliczaniu oceny końcowej z przedmiotu.					
<i>Osoby prowadzące przedmiot</i>	Justyna Wróblewska, dr					
<i>Informacje dodatkowe</i>	brak					