

METODY EKONOMETRYCZNE

INFORMACJE KONTAKTOWE

Jakub Mućk, jmuck@sgh.waw.pl

PROGRAM PRZEDMIOTU

- ★ **Model regresji liniowej. Wyprowadzenie estymatora MNK. Twierdzenie Gaussa-Markova. Własności estymatora MNK.**
Literatura: [Greene \(2011, rozdziały 1-4, załączniki A-C\)](#)
Literatura uzupełniająca: [Hill, Griffiths i Lim \(2011, rozdział 1-3, załączniki A-C\)](#).
- ★ **Estymator MNK z ograniczeniami. Testy istotności. Współliniowość. Normalność rozkładu składnika losowego. Specyfikacja modelu.**
Literatura: [Greene \(2011, rozdziały 5-6\)](#).
Literatura uzupełniająca: [Hill, Griffiths i Lim \(2011, rozdział 4-5\)](#).
- ★ **Niesferyczność składnika losowego. Heteroskedastyczność składnika losowego. Autokorelacja składnika losowego. Odporny estymator macierzy wariancji-kowariancji. Estymator FGLS.**
Literatura: [Greene \(2011, rozdziały 9, 20, 21\)](#).
Literatura uzupełniająca: [Hill, Griffiths i Lim \(2011, rozdział 8-9\)](#).
- ★ **Endogeniczność. Metoda zmiennych instrumentalnych. Ugoólniona metoda momentów.**
Literatura: [Greene \(2011, rozdział 8\)](#)
Literatura uzupełniająca: [Hill, Griffiths i Lim \(2011, rozdział 10\)](#).
- ★ **Modele wielorównaniowe. Problem identyfikacji. Metody estymacji parametrów. Dynamiczne modele wielorównaniowe.**
Literatura: [Greene \(2011, rozdział 10\)](#).
Literatura uzupełniająca: [Hill, Griffiths i Lim \(2011, rozdział 11\)](#).

Literatura

GREENE W. H. (2011): *Econometric Analysis*. Pearson.

HILL R., W. GRIFFITHS, G. LIM (2011): *Principles of Econometrics*. Wiley.