

EKONOMETRIJA

SMER: STATISTIKA I INFORMATIKA/ SEMESTAR: VII/ FOND ČASOVA: 60 + 60

I CILJ PREDMETA

Ekonometrija predstavlja sistematičan način povezivanja postavki ekonomske teorije sa izučavanjem stvarnih ekonomskih sistema, tako da je obavezan predmet na svim ekonomskim fakultetima u razvijenim zemljama. U suštini, da bi bilo koja teorijska tvrdnja u ekonomiji mogla biti empirijski dokazana, potrebno je koristiti ekonometrijske metode. Ekonometrija se zasniva na prilagođavanju matematičkih i statističkih metoda potrebama zaključivanja u ekonomiji, kroz proces modeliranja osnovnih ekonomskih međuzavisnosti. Tri osnovna cilja ekonometrije su: testiranje teorijskih hipoteza, predviđanje ekonomskih fenomena, i pomoć u donošenju odluka (definisane optimalne ekonomske politike i optimalnih izbora u poslovnom odlučivanju). Cilj ovog predmeta je savladavanje ekonometrijske metodologije, a kroz praktične primere i upotrebu računara osposobljavanje studenata da primenjuju ekonometriju u praksi.

II SADRŽAJ PREDMETA

Sadržaj predmeta se sastoji iz nekoliko celina. Pre svega, u uvodnom delu predstavljaju se osnovni metodološki principi, a u statističkom delu predstavljaju se osnovni metodi ocenjivanja i testiranja, pod uslovom ispunjenosti osnovnih pretpostavki klasičnog linearnog regresionog modela (KLRM). Zatim se, u okviru analize ekonometrijskih problema, razmatraju testovi i postupci u slučaju odsustva tih pretpostavki. U dodatnim delovima, razrađuju se osnovne osobine dinamičkih modela i najzad modeli simultanih jednačina, kao dva dodatna slučaja neispunjenih pretpostavki KLRM.

III PLAN RADA NA PREDMETU

Kalendar nastave kroz 30 dvostrukih časova predavanja i vežbi, sa temama i datumima izvođenja, u toku 15 nedelje održavanja:

TEMA RADA - zimski semestar 2006/2007	DATUM OBRADE	
	PREDAVANJA	VEŽBE
1. Uvod i metodologija ekonometrijskog istraživanja	9. oktobra	
2. Linearni modeli; pretpostavke o stohastičnosti	11. oktobra	12. okt.
3. Poželjne osobine ocena; distribucija ocena dobijenih metodom ONK	16. oktobra	
4. Statistički testovi značajnosti i analiza varijanse	18. oktobra	19. okt.
5. Metod maksimalne verodostojnosti; predviđanje ekonometrijskim modelom	23. oktobra	
6. Višestruki linearni regresioni model	25. oktobra	26. okt.
7. Testiranje značajnosti parametara i celog modela	30. oktobra	
8. Test linearnih ograničenja, dodatnih regresora i stabilnosti ocena	1. novembra	2. nov.
9. Greške specifikacije i njihove posledice	4. novembra	
10. Autokorelacija; izvori i uzroci pojave	6. novembra	9. nov.
11. Testiranje i otklanjanje autokorelacije	8. novembra	

12. Heteroskedastičnost (izvori, posledice, testiranje, otklanjanje)	13. novembra	16. nov.
13. Metod uopštenih najmanjih kvadrata	15. novembra	
14. Multikolinearnost - posledice i testiranje	18. novembra	23. nov.
15. Testiranje multikolinearnosti	20. novembra	
16. Metod glavnih komponenata	22. novembra	25. nov.
17. Veštačke varijable	27. novembra	
18. Približne i stohastičke varijable	29. novembra	30. nov.
19. Instrumentalne varijable	4. decembra	
20. Dinamički modeli; vreme kao nezavisna promenljiva	6. decembra	7. dec.
21. Raspoređene docnje	11. decembra	
22. Metodi ocenjivanja autoregresivnih modela	13. decembra	14. dec.
23. Simultane jednačine; pristrasnost usled simultanih uticaja	18. decembra	
24. Strukturna, redukovana i finalna forma modela	20. decembra	21. dec.
25. Rekurzivni sistemi	25. decembra	
26. Pojam identifikovanosti jednačina i celog modela	27. decembra	28. dec.
27. Formalni uslovi identifikovanosti	1. januara	
28. Metodi ocenjivanja modela simultanih jednačina	3. januara	4. jan.
29. Metod dvostepenih najmanjih kvadrata	8. januara	
30. Izbor metoda ocenjivanja simultanih jednačina	10. januara	11. jan.

IV NAČIN RADA NA PREDMETU

Nastava se izvodi kroz predavanja i vežbe, prema navedenoj strukturi predmeta, uz upoznavanje sa kompjuterskim paketom *EViews*. Predavanja se sastoje od oko 90% teorije (metodi, definicije, testovi, dokazi) i oko 10% ilustrativnih primera. Vežbe su posvećene primerima i zadacima kojima se utvrđuje gradivo, a održavaju se naizmenično u učionici i u kompjuterskoj laboratoriji. Zadaci na vežbama su nalik zadacima u *Zbirci zadaka* (dopunskom učilu), odn. zadacima na pismenom ispitu. Od studenata se pre ispita očekuje redovno pohađanje nastave, aktivno učešće u izradi primera i pozitivno ocenjen kolokvijum, a za studente koji se opredele za semestralne ili diplomske radove iz ovog predmeta, na raspologanju je širi spisak tema.

V OCENJIVANJE STUDENATA

U strukturi ukupne ocene, aktivno učešće na vežbama i predavanjima se vrednuje sa po 10%, a uspeh na kolokvijumu (koji je uslov za polaganje ispita u prvom ispitnom roku) sa dodatnih 10%. Kolokvijum sadrži 30 teorijskih pitanja i praktičnih primera, sa po tri ponuđena odgovora. Finalni ispit se sastoji od pismenog i usmenog dela. Pismeni ispit traje tri sata i sastoji se od nekoliko praktičnih primera, sa dopunskim pitanjima, pri čemu je minimum od 50% poena na pismenom ispitu uslov za pozivanje na usmeni ispit. Student koji je redovno dolazio na predavanje u vežbe i položio kolokvijum može biti pozvan na usmeni ispit i sa manje ostvarenih poena na pismenom ispitu. Početkom semestra studenti dobijaju spisak od 70 teorijskih pitanja, od kojih se dva na slučaj izvlače na usmenom ispitu. Dakle, strukturu ocene čine: pohađanje nastave i položeni kolokvijum sa 30%, a pismeni i usmeni ispit (praktični primeri i teorija) sa po 35%.

VI OSNOVNA LITERATURA

Udžbenik koji pokriva program predmeta i prateća zbirka od 100 rešenih zadataka su:

- Jovičić, M., *Ekonometrijski metodi*, Ekonomski fakultet, Beograd, 2002.
- Jovičić, M. i Kovačić, Z., *Zbirka zadataka iz teorijske i primenjene ekonometrije*, Ekonomski fakultet, Beograd, 2002.

VII NASTAVNICI I SARADNICI NA PREDMETU

Dr Milena Jovičić, redovni profesor; kabinet 412, tel. 3021176, konsultacije utorkom 12-14^h, e-mail: mjovicic@one.ekof.bg.ac.yu, mjovicic@ikomline.net

Mr Aleksandra Nojković, asistent, kabinet 708, tel. 3021084, konsultacije četvrtkom 12-16^h, e-mail: nojkovic@one.ekof.bg.ac.yu, nojkovic@eunet.yu