

Koło NAUKOWE SSiE

CEL

Celem naszego koła naukowego jest ćwiczenie praktycznego zastosowania metod ekonometrycznych. Zajmujemy się zastosowaniem teorii ekonometrii i statystyki do rzeczywistych problemów.

Oczekiwania wobec członków koła:

- Każdy z uczestników powinien przeprowadzić kompleksowe badanie ekonometryczne. (Szansa Publikacji)
- Powinien również szczegółowo przedstawić swój projekt pozostałym członkom koła naukowego, w tym:
 - Przygotować i udostępnić zbiór danych, na których było wykonane badanie
 - Przygotować i udostępnić kody do programów, w których było wykonane badanie
 - Szczegółowo omówić wykorzystaną w badaniu metodę ekonometryczną
 - Pokazać w jakich innych przypadkach może być ta metoda stosowana

Co oferujemy:

- Pomoc w wyborze tematu lub dla mniej zdecydowanych propozycję tematu
- Nadzór nad prowadzonymi badaniami
- Prezentacja badań ekonometrycznych, w takim samym wymiarze jakiego oczekujemy od uczestników koła
- Możliwość zapraszania znanych ekonometryków, którzy zaprezentują konkretne problemy ekonomiczne i właściwe dla nich problemy estymacyjne.
- Przede wszystkim jednak oferujemy możliwość warsztatowego podejścia do omawianych zagadnień. Spotkanie członków koła, nie mają być równoważne

przeczytaniu książki ani artykułu – w trakcie spotkań omawiane będą praktyczne i teoretyczne aspekty związane z modelowaniem.

Dodatkowa motywacja:

Nagrodą dla najlepszych uczestników mógłby być wyjazd jako reprezentacja UW na doroczny konkurs ekonometryczny Econometric Game.

Propozycja programu:

Z założenia, w ramach koła będziemy działać w myśl zasady: stosowane narzędzia „... powinny być najbardziej proste, jak to możliwe, ale nie prostsze” w odniesieniu do konkretnych problemów natury ekonomicznej.

Chcielibyśmy, aby ekonometria przestała być postrzegana jako sztuka dla sztuki. Najważniejszą umiejętnością, jaką powinien osiąść każdy z uczestników koła naukowego ma być swoboda w doborze odpowiedniej techniki estymacji, w odpowiedzi na palący problem ekonomiczny, nie odwrotnie.

W propozycji programowej, zaczniemy od wymienienia problemów ogólnie pojętej ekonomii:

- Jak modelować efekty prowadzonej polityki ekonomicznej, na wybraną część gospodarki?
- W jaki sposób modelować złożone systemy gospodarcze – modele strukturalne, modele VAR, SVAR, SVECM?
- Jak skorzystać z dobrodziejstw danych panelowych?
- W jaki sposób szacować modele makroekonomiczne, w których występują zmienne z przyszłości? (wszelkie problemy optymalizacji dynamicznej)
- Jak modelować zmienność (niepewność) na rynkach finansowych?
- Jak estymować modele, w których parametry zmieniają się w czasie?
- Czy możliwe jest wnioskowanie o strukturze-przyczynowo skutkowej na podstawie danych empirycznych?

Planujemy zająć się dwoma dużymi grupami ekonometrycznych technik estymacji, w obu przypadkach idea polegałaby na analizie typu od najprostszej do coraz bardziej złożonej metody estymacji. Chcielibyśmy przeanalizować jakie praktyczne problemy wymuszają od badaczy stosowanie coraz bardziej złożonych metod estymacji.

- W skład pierwszej grupy wchodzi metody: Regresja Liniowa, Regresja Nieliniowa oraz Uogólniona Metoda Momentów
- W skład drugiej grupy wchodzi metody: Metoda Największej Wiarygodności oraz Quasi MNW.

W ramach przeprowadzanych badań chcielibyśmy zwrócić szczególną uwagę, na praktyczne problemy związane z estymacją modeli ekonometrycznych. M. in. takich problemów jak:

- Autokorelacja składnika losowego
- Heteroskedastyczność składnika losowego
- Endogeniczność zmiennych
- Nieobserwowalność zmiennych
- Współliniowość zmiennych
- Obserwacje ucięte
- Samoselekcja