

1. Uvod v ekonometrijo

doc. dr. Miroslav Verbič

miroslav.verbic@ef.uni-lj.si

www.miroslav-verbic.si



Ljubljana, februar 2014

Definicija ekonometrije

EKONOMETRIJA ↔ **ECONOMETRICS**

“Zveza med matematiko, statistiko in ekonomijo; opravka imamo z novo disciplino, ki jo ob pomanjkanju boljšega imena lahko poimenujemo **ekonometrija**. Cilj ekonometrije je soočiti abstraktne zakone teoretične politične ekonomije oziroma “čiste” ekonomije z eksperimentalno in numerično verifikacijo ter s tem spremeniti čisto ekonomijo, kolikor je to mogoče, v znanost v striktnem pomenu besede.”

Ragnar Frisch, 1926. leta

Definicija ekonometrije

Ragnar Frisch (1895 – 1973)

Dobitnik prve Nobelove nagrade za ekonomijo,
skupaj z J. Tinbergenom leta 1969



Definicija ekonometrije

ECONOMETRICS

OIKOS **NOMOS** **METRON**
HIŠA, GOSPODARSTVO **NAUK, VEDA** **MERA**

29. december 1930, Statler Hotel, Cleveland

Šestnajstim najvidnejšim ekonomistom predsedoval Joseph Schumpeter
Econometric Society

1933. leta izide prvi zvezek revije *Econometrica*

Definicija ekonometrije

Samuelson P. A. (1954), Report of the Evaluate Committee for Econometrica, *Econometrica*, vol. 22, str. 141-146:

Ekonometrija predstavlja kvantitativno analizo ekonomskih pojavov, ki temelji na soočenju obstoječe ekonomske teorije z dejanskimi dogajanjem ob uporabi ustrezne metode statističnega sklepanja.

Klein L. R. (1962), *An Introduction to Econometrics*, Prentice-Hall, Englewood Clifs:

Glavni namen ekonometrije je dati empirično vsebino a priori razmišljanjem v ekonomski vedi (ekonomiji).

Malinvaud E. (1966), *Statistical Methods of Econometrics*, North-Holland, Amsterdam:

Namen (cilj) ekonometrije je empirična določitev (ugotovitev) ekonomskih zakonov. Ekonometrija zaokrožuje teorijo, z uporabo številčnih podatkov preverja obstoj predpostavljenih povezav (odvisnosti) in določa njihovo obliko.

Definicija ekonometrije

Tintner G. (1968), *Methodology of Mathematical Economics and Econometrics*, University of Chicago press, Chicago:

Ekonometrija je uporaba matematične statistike na podatkih gospodarstva (ekonomije), da se empirično podpre modele, pripravljene v okviru teoretične ekonomije, z namenom dobiti numerične (kvantitativne) rezultate.

Goldberger A. S. (1964), *Econometric Theory*, John Wiley & Sons, NY:

Ekonometrijo lahko definiramo kot družbeno vedo, pri kateri orodja ekonomske teorije, matematike in statističnega preverjanja (presoje, inference), uporabimo v analizi ekonomskih pojavov.

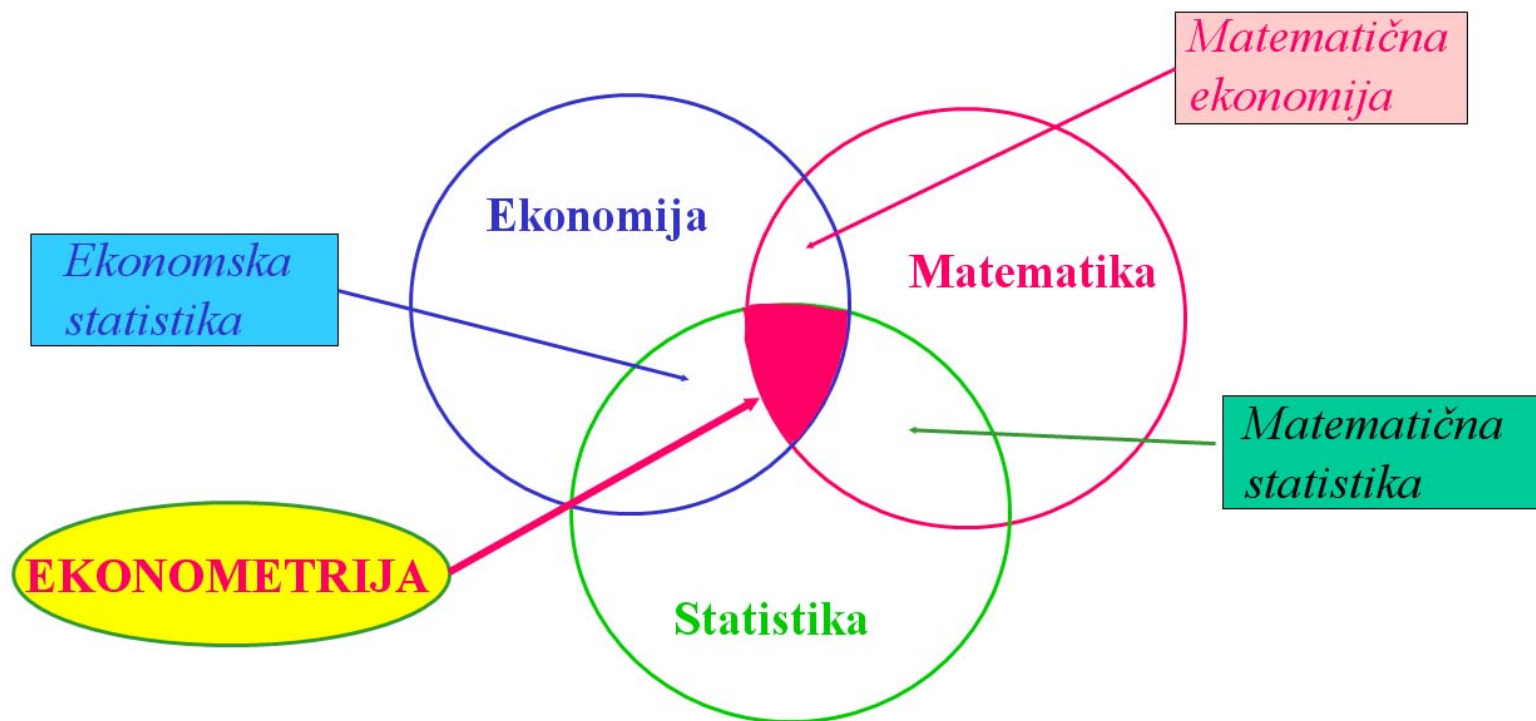
Theil H. (1971), *Principles of Econometrics*, John Wiley & Sons, NY:

Ekonometrija se ukvarja z empiričnim določevanjem (ugotavljanjem) ekonomskih zakonitosti.

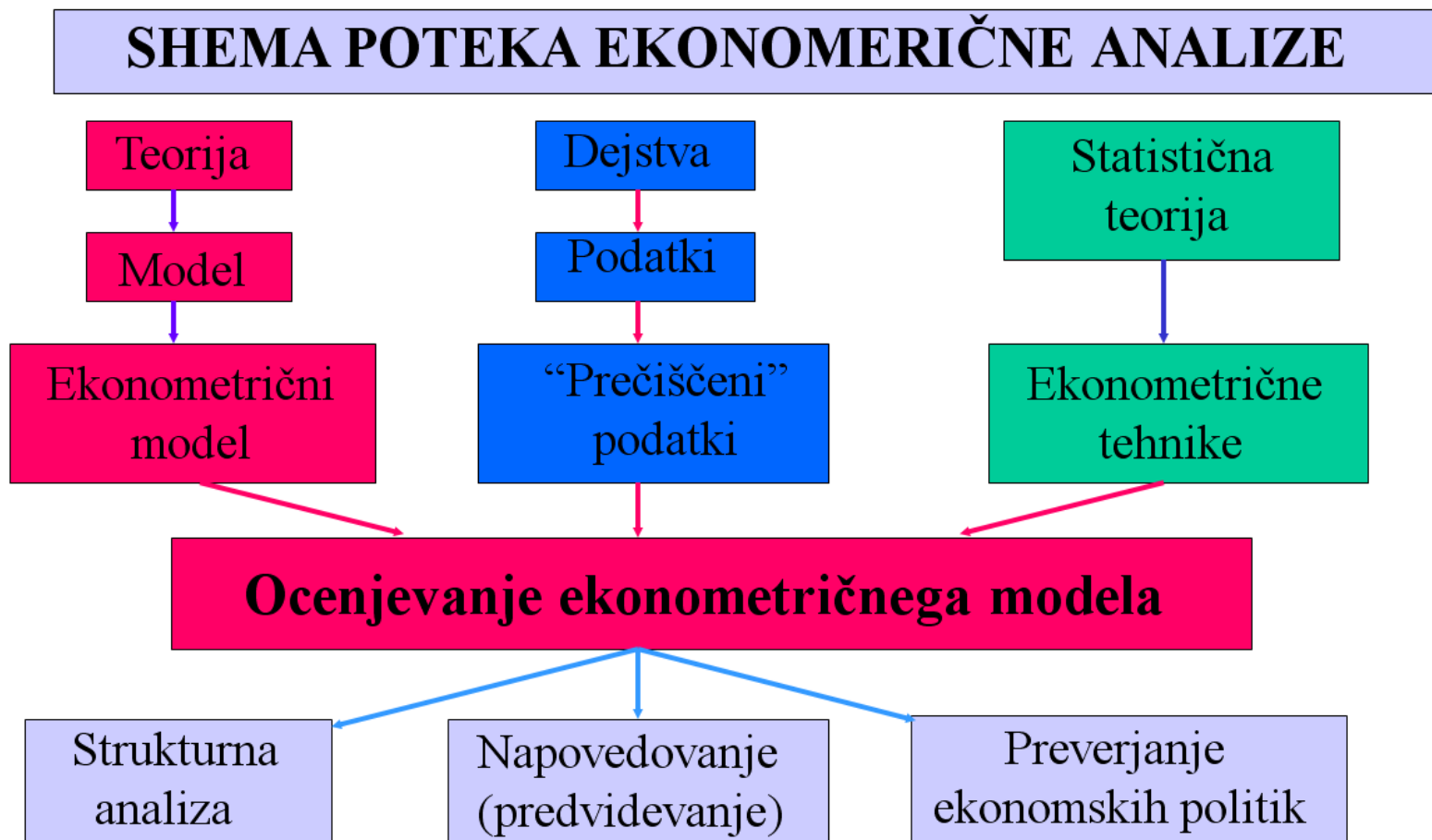
ŠE DEFINICIJA EKONOMETRIKA:

Ekonometrik je preprosto ekonomist, ki poizkuša razumeti delovanje ekonomskega sistema in pri tem uporablja metode in postopke, ki temeljijo na statistični metodologiji in so pogosto posredovani v matematičnem jeziku. (J. Stewart, 1991)

Definicija ekonometrije



Potek ekonometrične analize



Lastnosti ekonometričnega modela

Christ (1966) omenja šest željenih lastnosti, ki naj bi jih imel ekonometrični model:

1. **Relevantnost** – model naj bi obravnaval pomemben in zanimiv problem in ne sme biti kot “igrača”, ki služi le intelektualnemu zadovoljstvu.
2. **Preprostost** – model naj bi predstavljal ekonomske povezave v najbolj preprosti možni obliki (varčnost, parsimoničnost). Njegov pomen mora biti razumljiv, tako da omogoča logične in analitične operacije.
3. **Teoretična sprejemljivost** – specifikacija modela naj bi bila v skladu z domnevami (postulati) ekonomske teorije.

Lastnosti ekonometričnega modela

4. **Pojasnjevalna moč** – model mora biti sposoben v čimboljši meri razložiti dejanska dogajanja. Biti mora v skladu z opazovanimi gibanji ekonomskih spremenljivk, ki so vključene v model.
5. **Zanesljivost ocenjenih koeficientov** – ocene koeficientov modela naj bi bile čimbolj natančne.ocene naj bi imele tudi željene ekonometrične lastnosti, kot so nepristranskost, doslednost (konsistentnost) in učinkovitost.
6. **Napovedna moč** – na podlagi ocenjenega modela naj bi bilo možno pripraviti zadovoljiva predvidevanja oziroma napovedi vrednosti odvisnih (endogenih) spremenljivk pri danih vrednostih pojasnjevalnih (eksozenih) spremenljivk.

M. Friedman: “Pojasni veliko s čim manj.”

1. Uvod v ekonometrijo

doc. dr. Miroslav Verbič

miroslav.verbic@ef.uni-lj.si

www.miroslav-verbic.si



Ljubljana, februar 2014