

mgr Małgorzata Łukasik

Wyższa Szkoła Handlu i Prawa im. Ryszarda Łazarskiego

Katedra Metod Ilościowych w Naukach Ekonomicznych

Warszawa

Estymacja i prognozowanie liniowego modelu ekonometrycznego z wieloma zmiennymi objaśniającymi na przykładzie budżetów gospodarstw domowych

Zgodnie z tytułem, w pracy wykorzystano estymację liniowego modelu ekonometrycznego z wieloma zmiennymi objaśniającymi w celu zbadania funkcjonowania budżetów gospodarstw domowych w Polsce w latach 1990–2002. W dalszej kolejności na jego podstawie wyznaczono prognozy (na 2003 r., 2004 r. i 2005 r.) odnoszące się do siedmiu zmiennych wyróżnionych w modelu. W analizowanym modelu wykorzystano budżety gospodarstw domowych jako jeden z bardzo wielu możliwych do zbadania zjawisk ekonomicznych.

Oszacowane parametry liniowego modelu ekonometrycznego i wyznaczone trendy dla poszczególnych zmiennych pozwoliły na podanie prognoz badanych zmiennych objaśniających i zmiennej objaśnianej. Mimo to, na prognozę taką ma wpływ bardzo wiele różnych czynników. Analiza względnych błędów prognoz poszczególnych zmiennych pozwala stwierdzić, że osiągnęły one wartości znacznie poniżej 10%. Można je zatem uznać za dopuszczalne. Ponadto, trafności prognoz również są do zaakceptowania.

Przeprowadzona analiza ekonometryczna i sformułowane na jej podstawie prognozy pozwalają stwierdzić, że zastosowany model ekonometryczny może być z powodzeniem stosowany do estymacji i prognozowania wielu zjawisk ekonomicznych, na które wpływ ma wiele czynników.