

Modul	Statistika
Semestar	2
ESPB	10

EKONOMETRIJA PANELA
INFO PAKET

1. Sadržaj predmeta

Predmet Ekonometrija panela pokriva oblast ekonometrijske analize podataka koji predstavljaju kombinaciju uporednih podataka i vremenskih serija. Imajući navedeno u vidu, u cilju sticanja teorijskog i praktičnog znanja iz ovog predmeta, studentima se preporučuje da prethodno savladaju gradivo iz oblasti ekonometrije uporednih podataka i ekonometrijske analize vremenskih serija.

2. Program predmeta

Ekonometrija panela je izborni predmet na doktorskim studijama. Teorijska nastava obuhvata sledeća tri dela ekonometrije panela i u okviru njih metodološke jedinice:

- (1) statički modeli panela: modeli fiksnih efekata i modeli slučajnih efekata, testiranje ispunjenosti polaznih pretpostavki i metodi ocenjivanja; dinamički modeli panela i ocenjivanje uopštenim metodima momenata; sistemi jednačina;
- (2) modeli heterogenih i zavisnih panela, testovi jediničnog korena prve i druge generacije u panelu, kointegraciona analiza panela;
- (3) modeli panela sa diskretnom zavisnom promenljivom: modeli binarnog izbora, probit i logit modeli panela, metodi ocenjivanja i testiranja hipoteza.

Praktična nastava podrazumeva ekonometrijsko modeliranje podataka panela na primerima upotrebom softvera Stata.

Nastava se izvodi kroz predavanja, konsultacije i studijsko-istraživački rad. Na predavanjima se izučavaju teorijski modeli panela i upoznaje se sa njihovom ulogom u ekonomskim istraživanjima kroz primere iz prakse. Konsultacije podrazumevaju obradu literature i sticanje praktičnih znanja na osnovu rada kandidata na konkretnoj empirijskoj analizi upotrebom softvera Stata.

3. Literatura

Obavezna literatura:

- Baltagi, B.H., *Econometric Analysis of Panel Data*, 6th edition, ~~John Wiley & Sons~~ Springer, 2021.
- Greene, W.H., *Econometric Analysis*, 8th edition, Pearson, 2018.
- Jovičić, M. i Dragutinović Mitrović, R., *Ekonometrijski metodi i modeli*, Ekonomski fakultet, Beograd, 2011 (poglavlja 8 i 9).

Preporučena literatura:

- Baltagi, B. H., *The Oxford Handbook of Panel Data*, 1st edition, Oxford University Press, 2015.
- Hsiao C., *Analysis of Panel Data*, 3rd edition, Cambridge University Press, 2014.
- Matyas, L. and Sevestre, P. (eds.) *The Econometrics of Panel Data, Fundamentals and Recent Developments in Theory and Practice*, 3rd edition, Springer Verlag, 2008.
- Nojković, A., *Odabrane ekonometrijske teme: metodologija i primena*, Ekonomski fakultet, Beograd, 2018.

4. Način polaganja ispita

Ispit se sastoji iz dva dela. Prvi deo podrazumeva pisanje pristupnog rada (40 poena), dok se usmeni deo sastoji iz prezentacije tog rada i diskusije o dobijenim rezultatima (60 poena).

5. Nastavnici i kontakti

Dragutinović Mitrović Radmila
Nojković Aleksandra

e-mail: radmila.dragutinovic@ekof.bg.ac.rs

e-mail: aleksandra.nojkovic@ekof.bg.ac.rs