

SPRAWOZDANIA

BARBARA BATÓG, IWONA MARKOWICZ

XIV OGÓLNOPOLSKA KONFERENCJA „MIKROEKONOMETRIA W TEORII I PRAKTYCE”

W dniach 3-5 września 2009 roku odbyła się XIV Ogólnopolska Konferencja „Mikroekonometria w teorii i praktyce”. Konferencja została zorganizowana przez Katedrę Ekonometrii i Statystyki Uniwersytetu Szczecińskiego oraz Instytut Analiz, Diagnoz i Prognoz Gospodarczych w Szczecinie. Obrady odbyły się na promie „Pomerania” w drodze ze Świnoujścia do Kopenhagi. Konferencja była również okazją do uczczenia 40-lecia pracy naukowej profesora Józefa Hozera, kierownika Katedry Ekonometrii i Statystyki.

W konferencji wzięło udział około 100 osób z 21 ośrodków naukowych z całej Polski oraz z praktyki. Zostało wygłoszonych 17 referatów i zaprezentowano około 60 posterów. Po owocnych obradach i dyskusjach naukowych uczestnicy konferencji wzięli udział w wycieczce po Kopenhadze.

Poniżej prezentujemy streszczenia wygłoszonych referatów (w kolejności alfabetycznej). Z treścią wygłoszonych referatów i zaprezentowanych posterów będzie można zapoznać się po wydaniu przez Uniwersytet Szczeciński recenzowanej monografii.

Prof. dr hab. Maria Balcerowicz-Szkutnik, prof. dr hab. Elżbieta Sojka (Akademia Ekonomiczna w Katowicach), *Analiza aktywności ekonomicznej osób w wieku 50+ w wybranych krajach UE*

Autorki przedstawiły ogólne tendencje zmian w strukturze ludności według wieku oraz w aktywności zawodowej pokolenia 50+ w krajach nadbałtyckich Unii Europejskiej. Cztery z tych krajów, tj. Dania, Finlandia, Niemcy, Szwecja, to kraje „starej” Unii natomiast Estonia, Litwa, Łotwa i Polska należą do grupy nowych członków UE. Badaniem objęto lata 1996-2008 oraz przedstawiono prognozy liczby osób w wieku 50+. Dokonano również analizy stanu obecnego i prognozy zmian parametrów charakteryzujących rynek pracy, czyli współczynników aktywności zawodowej i wskaźnika zatrudnienia oraz stopy bezrobocia ogółem i bezrobocia długoterminowego.

Prof. dr hab. Stanisława Bartosiewicz (Uniwersytet Ekonomiczny we Wrocławiu), *Magiczne słowo „produkt”*

Autorka przedstawiła kilka refleksji dotyczących terminologii naukowej, a w szczególności używania teraz terminu (zdefiniowanego dawno) w znacznie rozszerzonym zakresie. Termin ten to właśnie wymienione w tytule magiczne słowo produkt. Rozważone zostały skutki wynikające z rozszerzenia pojęcia *produkt* na pojęcie *usługa* w procedurze konstrukcji funkcji produkcji (zmiany w mierzaniu produkcji oraz czynników warunkujących jej zmienność) oraz w trudnościach wyróżnienia roli pracy żywej świadczącej na rzecz usług.

Prof. dr hab. Andrzej Bąk (Uniwersytet Ekonomiczny we Wrocławiu), *Zastosowanie mikroekonomicznych modeli zmiennych dychotomicznych w badaniach preferencji i ich estymacja w programie R*

Program R zawiera pakiety i funkcje, które można wykorzystać w celu analizy mikrodanych o preferencjach i wizualizacji wyników. Autor przedstawił przykład analizy mikrodanych ankietowych za pomocą modeli zmiennych dychotomicznych szacowanych w programie R. Mikrodane dotyczyły preferencji w zakresie odżywiania się studentów oraz preferencji osób urzędujących ogrody.

Prof. dr hab. Ewa Drabik (Szkoła Główna Gospodarstwa Wiejskiego), *O pewnej modyfikacji teorii fal Elliotta*

Teoria fal Elliotta to jedno z ciekawszych narzędzi diagnostycznych odnoszącym się do prognozowania przyszłych ruchów cen na giełdzie. Celem pracy było sprawdzenie, w jaki sposób modyfikacja ciągu Fibonacciego wprowadzona przez Ulama, zawierająca element losowości, pozwoli na bardziej adekwatne do rzeczywistości analizowanie fal giełdowych. Wprawdzie ze względu na nieskończoną liczbę realizacji tego ciągu prognozowanie jest raczej trudne, ale być może w przyszłości uda się również i ten problem rozwiązać.

Prof. dr hab. Jan Gajda (Uniwersytet Łódzki), *Ekonometryczna wycena wartości mieszkania*

Autor zbudował model ekonometryczny służący do szacowania wartości nieruchomości. Rozpatrywano duży zestaw potencjalnych zmiennych objaśniających zarówno ilościowych, jak i jakościowych opisujących cechy fizyczne mieszkań z bazy danych liczącej kilka tysięcy obiektów. Oprócz tego typu zmiennych, do potencjalnych zmiennych objaśniających, zaliczono również kilka zmiennych z otoczenia makroekonomicznego.

Prof. dr hab. Stefan Grzesiak, mgr inż. Robert Józwiak (Uniwersytet Szczeciński), *Wybór miejsca i formy opodatkowania firmy jako problem decyzyjny*

Autorzy skupili uwagę na problematyce dotyczącej małych i średnich firm, które mają z reguły najwięcej kłopotów z otoczeniem ekonomiczno-prawnym, a jednocześnie z braku dostatecznego potencjału ekonomicznego nie posiadają zorganizowanej własnej bazy doradczej. Zasadniczym tematem prezentowanej pracy był wybór przez przedsiębiorców zamierzających prowadzić lub już prowadzących działalność gospodarczą w Polsce i w Niemczech miejsca i sposobu opodatkowania. Ze względu na historyczną odmienność systemów podatkowych w obu krajach, przedsiębiorca powinien świadomie dokonywać wyboru kraju, w którym będzie zarejestrowany i w którym powinien płacić podatek. Dla ogólności rozważań założono, że podatek jest płacony w obu krajach, a efektem przeprowadzonej dyskusji i w następstwie procedury optymalizacyjnej powinien być taki dobór dochodów w obu krajach, aby suma płaconych podatków była minimalna.

Prof. dr hab. Józef Hozer (Uniwersytet Szczeciński), *Sklonności a teoria uczuć i działań Vilfredo Pareto*

Autor odniósł się do wprowadzonego przez Pareto pojęcia rezyduów, zwanych też osadami psychicznymi. Podział rezyduów na klasy według Pareto można modyfikować. Należałoby skłonności podzielić według zasadniczych celów działań ludzkich, które ujmuje geometryczna interpretacja osobowości ludzkiej: cele materialne, intelektualno-duchowe i seksualne. Na tym tle Autor prowadził rozważania o skłonnościach, które odgrywają znaczącą rolę w przestrzeni ekonomicznej.

Prof. dr hab. Michał Kolupa (Politechnika Radomska), *O wyznaczaniu pewnych charakterystyk jednorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego*

W pracy omówiono wyznaczanie zarówno wektora wartości teoretycznych, wektora reszt oraz wartości prognozowanej zmiennej endogenicznej jednorównaniowego modelu ekonometrycznego szacowanego klasyczną metodą najmniejszych kwadratów. Przedstawiono zarówno klasyczne postępowanie, jak i postępowanie wykorzystujące macierze brzegowe. W praktyce ekonometrycznej bardzo często zachodzi konieczność wyznaczenia niecałego wektora wartości teoretycznych, jak również niecałego wektora reszt, lecz jedynie wybranej jego składowej. W tym przypadku powinno być zastosowane twierdzenie Kroneckera-Capelliego.

Prof. dr hab. Anna Malina (Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie), *Ocena realizacji założeń i celów Strategii Lizbońskiej w obszarze rynku pracy w krajach Unii Europejskiej*

Autorka przedstawiła założenia i cele Strategii Lizbońskiej w dziedzinie zatrudnienia. Skoncentrowała uwagę na dyrektywach dotyczących wskaźników zatrudnienia w UE (zatrudnienie ogółem, kobiet oraz starszych pracowników). Przedstawiła także sytuację w zakresie bezrobocia w Polsce na tle krajów Unii Europejskiej oraz zwróciła uwagę na dyrektywę dotyczącą czasu pracy. Z przeprowadzonych badań wynika, że sytuacja Polski na tle krajów UE pod względem zatrudnienia jest dosyć niekorzystna. Dotyczy to zarówno zatrudnienia mężczyzn, kobiet, jak i starszych pracowników.

Prof. dr hab. Paweł Miłobędzki (Uniwersytet Gdański), *Czy ceny akcji na Giełdzie Papierów Wartościowych w Warszawie S.A. są prognozowalne? Uwagi w świetle wyników testów hipotezy błędzenia przypadkowego*

Autor testował hipotezę błędzenia przypadkowego: zmiany cen (instrumentów finansowych) kształtują się w taki sposób, że są nieprognozowalne. Otrzymane wnioski to: brak podstaw do odrzucenia hipotezy błędzenia przypadkowego dla wszystkich głównych indeksów GPW w Warszawie S.A. oraz jej modyfikacji (niesymetryczny powrót do średniej logarytmicznych stóp zwrotu), stopy zwrotu z większości portfeli naśladowujących główne indeksy giełdowe GPW w Warszawie S.A. – poza stopami zwrotu z portfeli naśladowujących indeksy WIG20 i WIG-Telekomunikacja – są prognozowalne, pomimo prognozowalności stóp zwrotu brak efektywności rynku (rynków cząstkowych) wątpliwy – średnie stopy zwrotu bliskie zeru.

Prof. dr hab. Jerzy Czesław Ossowski (Politechnika Gdańska), *Mikro i makroekonomiczne podstawy zapotrzebowania na pracę w teorii i rzeczywistości gospodarki polskiej*

Autor przedstawił najpierw teoretyczne modele zapotrzebowania na pracę, a następnie zaprezentował oszacowanie dynamicznego kwartalnego modelu zapotrzebowania na pracę w dwóch wariantach. Dokonał również symulacji dynamiki produktu krajowego i dynamiki zapotrzebowania na pracę.

Prof. dr hab. Krzysztof Piasecki (Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu), *Zbiory intuicyjne w analizie rynku finansowego – możliwości i perspektywy*

Jednym z problemów, z jakimi spotykamy się przy zarządzaniu rynkiem finansowym jest pewna nieprecyzyjność pojęć stosowanych przy analizowaniu jego właściwości. Do opisu tej nieprecyzyjności stosuje się najczęściej teorię podzbiorów rozmytych. Pojęcie zbioru intuicyjnego jest istotnym rozszerzeniem pojęcia zbioru rozmytego i dlatego uzyskiwane tą drogą wyniki mogą wzbogacić naszą dotychczasową wiedzę o rynkach finansowych. W pracy Autor zaproponował metodę modelowania stanów rynku finansowego za pomocą zbiorów intuicyjnych.

Prof. dr hab. Józef Pocięcha (Uniwersytet Ekonomiczny w Krakowie), *Probabilistyczne podejście w rewizji finansowej*

Rewizja sprawozdań finansowych opiera się na uregulowaniach prawnych krajowych, wynikających z ustawy o rachunkowości, krajowych standardach rachunkowości i standardach rewizji finansowej lub uregulowaniach międzynarodowych, wynikających z dyrektyw UE, MSSF czy MSRF. Biegli posługują się także normami wykonywania zawodu i szeregiem procedur rewizyjnych, które w większości mają charakter probabilistyczny. Autor postuluje zwrócenie szczególnej uwagi na dobór reprezentatywnej próby z populacji operacji księgowych w badanym okresie (najczęściej rocznym), ocenę konsekwencji przyjmowania założenia o normalności rozkładu błędów w populacji, uwzględnienie szerszej gamy rozkładów błędów w populacji operacji księgowych oraz poszukiwanie testów najmocniejszych dla badania skuteczności działania systemów kontroli wewnętrznej.

Prof. dr hab. Mirosław Szreder (Uniwersytet Gdański), *O znaczeniu informacji spoza próby w statystyce i ekonometrii*

Autor wskazuje na konieczność efektywnego korzystania w badaniach statystycznych, w szczególności we wnioskowaniu statystycznym, z innych poza próbą badawczą źródeł informacji (w tym informacji *a priori*). Zatem należy włączyć Bayesowskie wnioskowanie do programów nauczania statystyki matematycznej, gdyż istnieją coraz bogatsze zbiory informacji o badanych populacjach, zgromadzonych doświadczeniach i wiedzy badaczy, które mogą poprawić jakość wnioskowania w stosunku do podejścia opartego wyłącznie na próbie losowej, a z drugiej strony model Bayesowskiego wnioskowania, wolny od problemów numerycznych, stanowi bardziej adekwatny od klasycznego podejścia opis przetwarzania przez człowieka informacji i podejmowania decyzji.

Prof. dr hab. Jan Jacek Sztandynger, dr Paweł Baranowski (Uniwersytet Łódzki), *Rodziny kapitał społeczny a wzrost gospodarczy – analiza dla Polski i 15 krajów Unii Europejskiej*

Ważnym składnikiem kapitału społecznego jest kapitał więzi rodzinnych – tzw. rodzinny kapitał społeczny. Autorzy postawili hipotezę: rodzinny kapitał społeczny – więzi rodzinne wpływają pozytywnie na wzrost gospodarczy. Im więcej rozwodów, w stosunku do nowo zawieranych małżeństw, tym wolniejszy

wzrost gospodarczy. Weryfikacji tej hipotezy dokonano w oparciu o model ekonometryczny dynamiki PKB, która została uzależniona od współczynnika rozwodów (relacji rozwodów do małżeństw), stopy inwestycji oraz stopy inflacji.

Prof. dr hab. Marek Walesiak, dr Andrzej Dudek (Uniwersytet Ekonomiczny we Wrocławiu), *Odległość GDM dla danych porządkowych a klasyfikacja spektralna*

Autorzy zaproponowali modyfikację metody klasyfikacji spektralnej umożliwiającą jej zastosowanie w klasyfikacji danych porządkowych. W tym celu w typowej procedurze klasyfikacji spektralnej dla danych metrycznych w konstrukcji estymatora jądrowego zastosowana została odległość GDM dla danych porządkowych (odległość GDM2).

Prof. dr hab. Józef Zając (Katolicki Uniwersytet Lubelski Jana Pawła II), *Zagadnienia ekstremalne w teorii regresji*

Autor sformułował problem regresji przy ściśle określonych założeniach. Zaprezentował również dwa sposoby efektywnego wyznaczania funkcji regresji. Rozważania zostały poparte przykładami.