

**IVANIČOVÁ, Z. – CHOCHOLATÁ, M. – SURMANOVÁ, K.: *Ekonometrické modelovanie*. Bratislava: Vydavateľstvo Ekonóm, 2012, 352 s., ISBN 978-80-225-3381-2.**

V roku 2012 vyšla vo Vydavateľstve EKONÓM publikácia z oblasti ekonometrie, dynamicky sa rozvíjajúcej vednej disciplíny, s názvom *Ekonometrické modelovanie*. Cieľom publikácie je formulácia základných teoretických princípov tvorby ekonometrických modelov, objasnenie teoretických prístupov a algoritmov odhadov parametrov ekonometrických modelov a ilustrácia týchto teoretických prístupov a algoritmov pri odhade parametrov jednorovnicových, ako aj viacrovnícových ekonometrických modelov. Autorky v publikácii na ilustráciu danej problematiky prezentujú množstvo príkladov čerpaných z viacerých publikácií, ako aj vlastné príklady aplikované na slovenské dáta.

Publikácia je štruktúrovaná do ôsmich kapitol, súčasťou každej kapitoly je samostatná príloha. Prvé štyri kapitoly sú zamerané na jednorovnicové ekonometrické modely, v piatej kapitole je rozobratá problematika modelov so zdanlivo nesúvisiacimi regresiami a v posledných troch kapitolách sa autorky venujú ekonometrickým modelom v tvare simultánnych rovníc.

V prvej kapitole sa venuje pozornosť princípom konštrukcie jednorovnicového lineárneho ekonometrického modelu, metódam odhadu parametrov, ako aj vlastnostiam, ktoré by mal takýto model spĺňať. Autorky v rámci prvej kapitoly uvádzajú aj špecifické prístupy k odhadu parametrov v prípade nesplnenia požadovaných vlastností modelu.

Na problematiku dynamických ekonometrických modelov, obsahujúcich časovo posunuté premenné, je zameraná druhá kapitola. Princíp oneskorenia je časťou vlastnosťou v mnohých ekonomických procesoch, autorky prezentujú modely s rozloženým oneskorením, ako aj autoregresné modely. Teoretické formulácie modelov sú opäť doplnené viacerými príkladmi.

Analýza ekonomických hypotéz často potvrdí, že parametre modelu sú istým spôsobom previazané, resp. predpokladá sa ohraničenosť parametrov. Riešenie takto špecificky formulovaných modelov – modelov s ohraničenými parametrami pomocou dvoch princípov je teoreticky opísané a taktiež aj ilustrované na príkladoch v tretej kapitole.

Štvrtá kapitola je poslednou kapitolou zameranou na jednorovnicové ekonometrické modely a rieši problematiku odhadu parametrov modelu, keď musíme akceptovať nelineárny tvar modelu. V tejto časti publikácie

je uvedených niekoľko tvarov inherentne nelineárnych modelov a sú prezentované možnosti ich odhadu.

V ďalších kapitolách publikácie autorky rozšírili svoju pozornosť na viacrovnícové ekonometrické modely, keďže skúmanie ekonomických procesov ako čiastkových procesov pomocou jednorovnicových modelov neumožňuje analyzovať ekonomický systém ako celok. Špecifický tvar ekonometrických modelov v tvare sústavy lineárnych rovníc tvoria modely so zdanlivo nesúvisiacimi regresiami (SUR modely) a sú predmetom piatej kapitoly.

V posledných troch kapitolách je podrobne rozobraná problematika ekonometrických modelov definovaných v tvare simultánnych rovníc. V šiestej kapitole je definovaný základný princíp simultánnosti, premenné modelu, ako aj štruktúrny a redukovaný tvar modelu. V ďalšej kapitole sa rozoberá problematika identifikácie, keďže odhadu parametrov modelu v tvare simultánnych rovníc predchádza overenie podmienok identifikácie modelu. Rôzne metódy odhadov simultánnej sústavy sú uvedené v poslednej kapitole. V nadväznosti na uvedenú teóriu autorky poskytujú vysvetlené príklady a ich riešenie v softvéri EViews. Navyše, v prílohe poslednej kapitoly je uvedený komplexný viacrovnícový ekonometrický model.

Publikácia je predovšetkým určená študentom druhého a tretieho stupňa vysokoškolského štúdia zameraného na kvantitatívne analýzy ekonomických procesov na makroekonomickej a mikroekonomickej úrovni. Autorky publikácie sa problematike ekonometrického modelovania dlhodobo venujú v rámci pedagogického procesu na FHI EU v Bratislave, ako aj v rámci empirických analýz, čo je zárukou vysokej odbornej úrovne predkladanej publikácie. Publikácia má logické usporiadanie a umožňuje zvládnuť náročnú problematiku ekonometrického modelovania aj vďaka množstvu riešených modelových situácií s ekonomickou interpretáciou výsledkov s ohľadom na implementáciu v hospodárskej praxi. Vhodným spôsobom sprostredkúva teoretické poznatky a ich využitie pri riešení konkrétnych príkladov, čo vytvára predpoklad jej využitia aj odborne zdatnou verejnosťou z oblasti hospodárskej praxe alebo ekonomického výskumu.

*Andrea Furková*