

## Zadania Finanse i Rachunkowosc II stopien (2009 r.)

Pawel Baranowski

**Dany jest nastepujacy model wielorównaniowy:**

$$Oproc_t = \alpha_0 + \alpha_1 WIBOR_t + \alpha_2 Depozyty_t + \epsilon_{1t}$$

$$WIBOR_t = \beta_0 + \beta_1 inflacja_t + \beta_2 WIBOR_{t-1} + \epsilon_{2t}$$

**1. Do jakiej klasy zaliczymy ten model?**

- a) statyczny czy dynamiczny?
- b) prosty, rekurencyjny czy o równaniach lacznie współzależnych?

**2. Dla ponizszego modelu oblicz mnozniki bezposrednie**

(wczesniej oczywiscie zapisz ten model w postaci macierzowej; dla wygody obliczen mozna pominac wyrazy wolne)

$$\hat{Z}_t = 150 - 1,5W_t + 0,20Y_t + 0,1X_{t-1}$$

$$\hat{Y}_t = -40 + 0,25Z_t + 0,5K_t$$

gdzie:

$Z_t$  - zatrudnienie w przedsiebiorstwie ALFA (tys.)

$W_t$  - wynagrodzenia realne w Polsce (zl)

$Y_t$  - produkcja w przedsiebiorstwie ALFA (mln zl)

$K_t$  - srodki trwale w przedsiebiorstwie ALFA (mld zl)

$X_t$  - wartosc funduszy pomocowych UE jakie otrzymalo przedsiebiorstwo (mln zl)

**3. Jak zmieni sie zatrudnienie i produkcja w 2009 i 2010, gdy**

- a) wzrosna fundusze UE w 2009 roku (o 1 mln zl)
- b) wystapi spadek przecietnych wynagrodzen o 10 z w 2009 roku
- c) niektóre odpowiedzi byly oczywiste - które i dlaczego?

**4. Ocena przydatnosci modelu do prognozowania - zadania na mojej stronie**