

# Zbigniew Dulewicz

---

"Nowa ekonometria", W. W.  
Charemza, D. F. Deadman, tł. E. M.  
Syczyńska, Warszawa 1997 :  
[recenzja]

---

Acta Scientifica Academiae Ostroviensis nr 1, 183-188

---

1998

Artykuł został zdigitalizowany i opracowany do udostępnienia w internecie przez Muzeum Historii Polski w ramach prac podejmowanych na rzecz zapewnienia otwartego, powszechnego i trwałego dostępu do polskiego dorobku naukowego i kulturalnego. Artykuł jest umieszczony w kolekcji cyfrowej [bazhum.muzhp.pl](http://bazhum.muzhp.pl), gromadzącej zawartość polskich czasopism humanistycznych i społecznych.

Tekst jest udostępniony do wykorzystania w ramach dozwolonego użytku.

przedstawionym w tej publikacji z pewnością pogłębi wiedzę i przyczyni się do pełniejszego obrazu zagadnień integracji rolnej.

Marta Bład

**W. W. CHAREMZA, D. F. DEADMAN: *NOWA EKONOMETRIA*, PRZEKŁAD E. M. SYCZYŃSKA, PWE, WARSZAWA 1997**

Przemiany polityczne i gospodarcze w Polsce lat 90 oraz nadzieja na wejście do Unii Europejskiej wywołały między innymi potrzebę innego niż dotychczas analizowania zjawisk gospodarczych i rozbudziły wśród młodzieży ogromne zainteresowanie studiami ekonomicznymi oraz im pokrewnymi, a głównie metodami organizacji i zarządzania podmiotami gospodarczymi. W konsekwencji tego w istniejących już uczelniach rozbudowano lub utworzono, odpowiadające na to zapotrzebowanie, kierunki studiów, zaś przede wszystkim powstały dziesiątki wyższych szkół niepaństwowych, oferujących kształcenie w tym zakresie. Nowocześnie wykształcony ekonomista lub magister musi orientować się w matematyczno – statystycznych metodach opisywania i analizowania zjawisk gospodarczych i społecznych, a co za tym idzie – musi być zorientowany przynajmniej w niektórych metodach ekonometrycznych. W odpowiedzi na to zapotrzebowanie zaczęto drukować wiele opracowań i podręczników z ekonometrii i zwiększyła się wyraźnie liczba nauczycieli akademickich nauczających i zajmujących się tą dziedziną wiedzy. Trzeba tu otwarcie napisać, że część tych pracowników wcześniej nie zajmowała się profesjonalnie tymi zagadnieniami, zaś wielu młodych nauczycieli z powodów oczywistych mogło dotychczas poznać niewiele więcej niż na kursowym wykładzie w czasie studiów. Na szczęście w kraju mieliśmy, co prawda nieliczne, zespoły zawodowych ekonometryków o dużym dorobku naukowym i doświadczeniu dydaktycznym, które przygotowały kilka dobrych podręczników. Przetłumaczono również parę ważnych i uznanych pozycji z tego zakresu. Mamy więc sytuację korzystną, w której wiadomo z czego, jak i co przekazywać studentom. Tak więc lata 90 –te stały się w Polsce złotym okresem propagowania ekonometrii. W naukach ścisłych nowe rozwiązania i pomysły wymagają na ogół znajomości rozwiązań i pomysłów wcześniejszych. Ta hierarchiczność poznawania niektórych treści jest poważną przeszkodą merytoryczną i dydaktyczną w nauczaniu, nawet na poziomie akademickim. W przypadku ekonometrii jest ona

jeszcze większa z powodu niewielu godzin przeznaczonych na przedmiot i niedoceniań jego roli przez wielu pracowników reprezentujących dyscypliny pokrewne. A przecież w czasie zajęć należałoby pokazać oprócz pewnych algorytmów, również to, jak rozwijała się dana dziedzina wiedzy, co jest jej klasycznym dorobkiem, na jakie natrafiła przeszkody i jakie są aktualne kierunki badań. Te oczekiwania zaspokaja wydana w 1997 roku przez Polskie Towarzystwo Ekonomiczne książka *Nowa Ekonometria*, Wojciecha W. Charemzy i Dereka F. Deadmana. Książka ta jest przekładem Ewy Marty Syczewskiej – w oryginale została wydana w języku angielskim w 1992r. Jak piszą Autorzy, wersja oryginalna powstała na podstawie wykładów z zakresu teorii zastosowań modelowania ekonometrycznego, jakie wygłaszali dla studentów na Uniwersytecie w Leicester. Książka jest skierowana do wszystkich tych, którzy chcą stosować nowoczesne metody ekonometryczne nawet w pracach nieekonometrycznych. Myślę, że szczególnie przydatna byłaby dla doktorantów, zajmujących się badaniami szeroko rozumianej gospodarki. Świetnie nadawałaby się, jako wiodąca, dla wykładu specjalnego lub seminarium u studentów starszych lat ekonomii oraz zarządzania i marketingu.

Aby zachęcić Czytelnika do sięgnięcia po tę pozycję, postaram się w dużym skrócie zarekomendować każdy z jej ośmiu rozdziałów. Wcześniej zwrócę jeszcze uwagę na to, że mimo częstego powoływania się przez Autorów na literaturę uzasadniającą formułowane myśli, mamy na końcu każdego rozdziału „sugestie dotyczące literatury”, zawierające oprócz wyrazów kompetentnych autorów i prac, bardzo zwięzłe i ujmujące istotę komentarze o zastosowaniach i alternatywnych podejściach do rozważanych teorii. Mamy w nich również wskazówki o aktualnych kierunkach badań, co może być szczególnie ważne dla pracowników naukowych. Za niedostatek książki w zakresie przywoływania literatury uznaję brak naszych krajowych ekonometryków. Charemza – uznany polski ekonometryk od lat pracuje poza granicami kraju.

W rozdziale pierwszym autorzy dokonują przeglądu tradycyjnej metodologii ekonometrycznej, szkicując zarazem jej historyczny rozwój. W zwięzłej i nowoczesnej formie ujmują postulaty metod ekonometrycznych i przytaczają uzyskane w oparciu o nie klasyczne rezultaty. Rozdział kończy się rozważaniami o kryzysie tradycyjnej ekonometrii, który pojawił się w drugiej połowie lat siedemdziesiątych. Wyraziło się to w dysproporcji między tym, co uzyskiwano w najbardziej wysublimowanych rozważaniach teoretycznych, a tym, co robili ekonometrycy zajmujący się rozwiązywaniem problemów codziennej praktyki ekonomicznej. Ci ostatni, na ogół nie znając metodologii

budowania modeli w praktyce, wypracowali własne podejście, które sprawiło, że wiele prac ekonometrycznych w dziedzinie zastosowań było nieprzekonujących. Ponadto okazało się, że użyteczność niektórych wielkich modeli makroekonomicznych jest niewielka i może być zastąpiona prostymi metodami szeregów czasowych.

Te oraz inne przyczyny sprawiły, że opinie o ekonometrii można było podzielić na trzy grupy:

- jest to swego rodzaju szarlataneria,
- podstawy są właściwe, zaś kryzys wynika z błędnej specyfikacji i niedoskonałej estymacji,
- zrewidować należy podstawy, czyli tzw. założenia Komisji Cowlesa.

Omawiana książka zawiera poglądy trzeciej grupy.

W rozdziale drugim Autorzy ukazują, w jaki sposób tzw. przerzucanie danych ma wpływ na wybór modelu oraz uzasadniają, że  $R$  oraz statystyki  $t$ -Studenta nie są zbyt mocnymi kryteriami tego wyboru, bowiem eksperymentator może wpływać na te wartości i w pewnym stopniu je kontrolować. Zatem wiarygodność, jaką można przypisywać dowolnemu oszacowaniu w modelu ekonometrycznym, jest z pewnością zależna od procesu, który doprowadził do jego uzyskania.

Po ukazaniu słabości założeń, a także metodologii tradycyjnej ekonometrii poznajemy w rozdziale trzecim źródła nowoczesnej metodologii, dla której impulsem stała się praca z 1978 roku autorstwa Dawidsona, Hendry'ego, Srby i Yeo (zwana skrótem DHSY), dotycząca modelowania zagregowanej funkcji konsumpcji dla Wielkiej Brytanii. Autorzy omawianej książki zapoznają nas z podstawami analizy DHSY w uproszczonej i zmodyfikowanej postaci, a także wprowadzają w teorię modelowania konsumpcji oraz objaśniają wydruki komputerowe, uzyskane dla pewnego pakietu oprogramowania ekonometrycznego (PC-GIVE). W rozdziale tym znajdujemy również podstawy teorii ekonomicznej, niezbędnej do formułowania modeli zagregowanych wydatków konsumpcyjnych, dochodu absolutnego i dochodu permanentnego oraz oceny parametrów tego modelu. Zapoznając się z tym rozdziałem zauważmy, że dobry empiryczny model ekonometryczny konsumpcji można zbudować startując od dość rozbudowanego modelu ogólnego i następnie stopniowo zredukować jego wielkość oraz przekształcić zmienne za pomocą testów w postaci liniowych i nieliniowych warunków ograniczających. Uogólnienie tego znajdujemy w rozdziale czwartym, w którym poznajemy, w jaki sposób od modelowania ogólnego możemy przejść do modelowania szczególnego (general – to –specific

modelling). Punktem wyjścia jest tu pewien model dynamiczny bez specjalnych ograniczeń, zwany modelem ogólnym. Następnie za pomocą mnożników Lagrange'a lub Walda, testujemy sensowne warunki ograniczające i tym sposobem redukujemy jego wielkość. Autorzy pokazują to na przykładzie modelu w postaci autoregresji z rozłożonymi opóźnieniami (Autoregressive Distributed Lag, ADL) z jedną zmienną objaśniającą:

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 y_{t-1} + \beta_2 x_t + \beta_3 x_{t-1} + \varepsilon_t$$

Następnie pokazują, że istnieje co najmniej dziesięć ekonomicznie sensownych modeli, które można otrzymać z powyższego przez nakładanie na parametry pewnych warunków ograniczających. Dla frakcji konsumpcji dla Wielkiej Brytanii mamy w książce stylizowany wydruk komputerowy (PC – GIVE).

W rozdziale piątym zapoznajemy się z analizą kointegracji w ekonometrii szeregów czasowych, która została wprowadzona w połowie lat osiemdziesiątych i uważana jest za najważniejszy element obecnego rozwoju modelowania ekonometrycznego. Dla lepszego rozumienia wywodów Autorzy przytaczają nieodzowne informacje dotyczące procesów stochastycznych, szeregów niestacjonarnych i procesów zintegrowanych. Dalej zapoznajemy się z istotą testowania stopnia integracji każdej zmiennej występującej w modelu za pomocą testów Dickey'a i Fullera (D-F), Dickey'a-Haszy-Fullera (DHF) oraz Hylleberga, Engle'a i Grangera i Yoo (HEGY).

Poważnym problemem dla ekonometrii empirycznej bywają szeregi czasowe, charakteryzujące się trendem, co może prowadzić do pozornych regresji, nieinterpretowalnych wartości statystyki t-Studenta oraz innych fałszywych informacji o badanym zjawisku. Jednym ze sposobów radzenia sobie z tym problemem jest wprowadzenie tzw. kointegracji dla szeregów czasowych i metod testowania. W książce znajdujemy przystępny i wyczerpujący wykład o tym zagadnieniu, ilustrację przykładem zagregowanej Konsumpcji DHSY oraz wykład komputerowy parametrów dla testów DHF i DF.

Szczególnie interesujące są rozważania rozdziału szóstego, w których ukazano słabości tzw. modeli strukturalnych oraz przedstawiono założenia pionierskiej dla nowoczesnej ekonometrii pracy Simsa. Założenia te są następujące:

- nie istnieje podział a priori na zmienne endo- i egzogeniczne,

- nie należy nakładać tzw. warunków zerowych, nie ma ścisłej, poprzedzającej modelowanie, teorii ekonomicznej, która stanowiłaby podstawę modelu.

Powyższe, rewolucyjne zasady mają dalekosiężne konsekwencje, a metodologia oparta o nie bywa często nazywana ateoretyczną makroekonomią. W oparciu o te założenia zbudowano tzw. modele wektorowej autoregresji (vector autoregressive model, VAR). W książce zapoznajemy się z podstawami modeli VAR, ekonometrycznymi pojęciami przyczynowości i wnioskowania w oparciu o nie. Poznajemy również różne warianty modelu VAR dla modelu DHSY wraz z wydrukami komputerowymi.

W rozdziale siódmym omówiono modelowanie egzogeniczności, jako swego rodzaju kompromisu między koniecznością ograniczania wielkości modelu a własnościami danych statystycznych użytych do modelowania. Innymi słowy, jest to połączenie elementów modelowania strukturalnego i modelowania VAR. W rozdziale tym znajdujemy próbę zdefiniowania egzogeniczności słabej i silnej przy założeniach, że interesujące nas parametry są niezmiennie w czasie i ze względu na zmiany wartości poszczególnych zmiennych – struktura takiego modelu jest zatem stała (model niezmienny). Dalej rozważa się skutki występowania zmian spowodowanych przez te zmienne, których wartości zależą od osób podejmujących decyzje odnośnie np. stopy procentowej, podatków, cel itp. Mamy tu więc swego rodzaju „zmiennie polityczne” (instrumenty, interwencje polityczne). W ten sposób dochodzimy do przypadku, w którym pewne zmienne można bezpiecznie wykorzystać jako instrumenty polityki gospodarczej, a zatem są one słabo lub silnie egzogeniczne i ich zmiany nie wpływają na parametry modelu. Pozwala to wprowadzić pojęcie superegzogeniczności zmiennej i przybliżyć tzw. krytykę Lucasa. Jak wiadomo, w 1976 r. Lucas zakwestionował zasadność wykorzystywania modeli ekonometrycznych do symulacji w dziedzinie polityki gospodarczej, stwierdzając, że struktura modelu, mimo nawet doskonałości oszacowań parametrów i jego stabilności w okresie prób, nie może się zmienić pod wpływem oczekiwań dotyczących polityki. W rozdziale tym znajdujemy objaśnienia tego problemu na konkretnym przykładzie. Warto zauważyć, że prac na temat egzogeniczności i superegzogeniczności jest jeszcze niewiele.

Jak wiadomo, największym problemem w ekonometrii jest wybór najlepszego modelu. Ponieważ tego a priori nie wiadomo, prawie nieprawdopodobnym jest, aby uzyskane modele pewnego, bardziej złożonego zjawiska były jednakowe. Temu zagadnieniu poświęcony jest ósmy i ostatni rozdział książki. Znajdujemy tu testy wyboru modelu, a

wśród nich mało jeszcze znany i badany test obejmowania. Ilustracją testu obejmowania jest porównanie funkcji konsumpcji DHSY z odpowiadającą jej funkcją otrzymaną z dynamicznego modelu popytu Houthakera – Taylora. Do związanych z tym rozważań teoretycznych dołączony jest stylizowany wydruk komputerowy.

Książka kończy się zestawem dziesięciu ćwiczeń, których rozwiązanie będzie potwierdzeniem zrozumienia omawianych treści, czego wszystkim czytelnikom serdecznie życzę.

Zbigniew Dulewicz

**L. GILICIŃSKI: *WYKONYWANIE PRAW WŁASNOŚCI INTELKTUALNEJ W PRAWIE WSPÓLNOTY EUROPEJSKIEJ, DOM WYDAWNICZY ABC 1997, s. 289***

Pełne członkostwo Polski we Wspólnocie Europejskiej będzie wymagało ogromnych zmian w dostosowaniu do standardów Wspólnoty - zarówno polskiej gospodarki, jak i ustawodawstwa. Wielką uwagę należy więc zwracać na wszelkie publikacje związane z działalnością WE, jak też dotyczące polskiego członkostwa w tej organizacji.

Oba te warunki spełnia książka Lecha Gilicińskiego zatytułowana: *Wykonywanie praw własności intelektualnej w prawie Wspólnoty Europejskiej*, wydana w 1997 roku przez Dom Wydawniczy ABC. Dotyczy ona jednej z najważniejszych dziedzin prawa wspólnotowego - polityki konkurencji, bez której nie można byłoby osiągnąć zamierzonego celu - wspólnego rynku. Została ona unormowana w Traktacie Rzymskim w artykułach 85 - 94. W przedstawianym opracowaniu autor zawęził krąg swoich badań do mało znanego lecz niezwykle ważnego prawa własności intelektualnej. Omawiana pozycja liczy 289 stron i składa się z dwóch części:

- pierwsza dotyczy ograniczeń wykonywania praw własności intelektualnej wynikających z prawa o swobodnym przepływie towarów i reguł konkurencji EWG;
- druga - wykonywania praw własności intelektualnej w świetle Układu Europejskiego ustanawiającego stowarzyszenie między Rzeczypospolitą Polską a Wspólnotą Europejską i państwami członkowskimi WE.