

Niektóre pytania na dotychczasowych kolokwium z ekonometrii opisowej

Absolutnie kluczowe (prawie na każdym kolokwium)

1. Interpretacja ocen parametrów w modelu liniowym i potęgowym
2. Ocena istotności parametrów
3. Ocena merytoryczna i statystyczna modelu ekonometrycznego (całościowa)
4. Sprawdzenie czy są spełnione warunki stosowalności MNK („Czy model może być estymowany przy pomocy MNK?”)
5. Interpretacja oraz obliczanie miar dopasowania (R^2 , R^2 skorygowany, Se)

Ważne

1. Własności estymatora MNK w przypadku spełnienia wszystkich założeń.
2. Jakie są skutki niespełnienia warunków stosowalności MNK?
3. Wymień 3 zastosowania zmiennych zerojedynkowych.
4. Ręczne oszacowanie parametrów przy pomocy wzoru na estymator MNK.
5. Kiedy interpretujemy wyraz wolny oraz testujemy jego istotność?
6. Kiedy nie możemy stosować testu Durбина-Watsona?
7. Skutki niespełnienia poszczególnych założeń (zwłaszcza: o braku autokorelacji / normalności rozkładu składników los. / braku heteroskedastyczności)?
8. Sposoby postępowania gdy stwierdzimy autokorelację.
9. Sposoby radzenia sobie z heteroskedastycznością.
10. Przyczyny autokorelacji (zwłaszcza zawinione przez twórcę modelu).
11. Zmienne zerojedynkowe: zmiana wyrazu wolnego a zmiana parametru kierunkowego.
12. Zmienne zerojedynkowe impulsowe a podtrzymane.
13. Zmiennej czasowa – zastosowanie w opisowym modelu ekonometrycznym (*bez prognozowania*).
14. Interpretacja parametrów w modelach z opóźnieniami zmiennych egzogenicznych oraz modelach zbudowanych na pierwszych przyrostach / tempach.
15. Klasyfikacja zmiennych w modelu wielorównaniowym.
16. Do jakiej klasy możemy zaliczyć dany model wielorównaniowy? Zapisać graf powiązań zmiennych.
17. Jakie metody estymacji stosujemy w przypadku modeli wielorówn. o równaniach współzależnych?

Dodatkowe

1. Testowanie łącznej istotności przy pomocy statystyki F.
2. Test autokorelacji Breusha-Goldfleda (LM).
3. Test specyfikacji RESET.
4. Kiedy stosujemy Metodę Zmiennych Instrumentalnych?
5. Podwójna MNK – kiedy stosujemy i jaka jest zasada działania.
6. Do czego służą modele logitowe i probitowe? [JEŚLI BYŁO W PROGRAMIE]
7. Metoda *fixed effects* (model z efektami ustalonymi) – kiedy i dlaczego stosujemy? Podać krótko zasadę działania [JEŚLI BYŁO W PROGRAMIE].
8. Współliniowość „przybliżona” (skorelowanie zmiennych objaśniających) – skutki oraz wybrane 1-2 sposoby radzenia sobie z tym problemem.
9. Postać strukturalna i zredukowana wielorównaniowego modelu ekonometrycznego.