

Zakres materiału do kolokwium z ekonometrii dla grup 6 i 7 II roku MSD FiB

1. Regresja liniowa jednej zmiennej (metoda najmniejszych kwadratów), współczynnik korelacji liniowej Pearsona, regresja wieloraka (założenia modelu liniowego – jakie są, co się może zdarzyć, gdy nie zostaną spełnione; orientacja we własnościach macierzy).
2. Dobór zmiennych objaśniających metodą współczynnika korelacji wielorakiej.
3. Dobór zmiennych objaśniających metodą analizy współczynników korelacji.
4. Dobór zmiennych objaśniających metodą wskaźników pojemności informacji.
5. Dobór zmiennych objaśniających metodą grafową.
6. Transformacja liniowa.
7. Dopasowanie modelu do danych empirycznych (R-kwadrat, dopasowany R-kwadrat, współczynnik zbieżności).
8. Istotność parametrów strukturalnych (test F i podstawowa wersja testu t).
9. Badanie autokorelacji składnika losowego.
10. Heteroscedastyczność.
11. Normalność rozkładu składnika losowego (bez testu Kołmogorowa).
12. Badanie losowości.
13. Analiza produkcji.
14. Analiza popytu.
15. Analiza kosztów.

Przypominam, że na kolokwium będzie można zdobyć maksymalnie 30 pkt, a każde poprawnie rozwiązane zadanie można otrzymać 2 pkt. W powiązaniu z powyższą listą chyba nie muszę tłumaczyć, co to oznacza... ;-)

Na kolokwium koniecznie trzeba zabrać ze sobą skserowane tablice statystyczne z książki „Ekonometria. Metody, przykłady, zadania” pod redakcją prof. Józefa Dziechciarza. Inne tablice nie będą potrzebne. Można mieć również kalkulatory oraz wzory (wyłącznie w formie: wzór + tytuł wzoru, bez dodatkowego opisu). Należy znać postacie testowanych hipotez oraz obszary krytyczne testów (lub umieć je wywnioskować ze wzorów na statystyki testowe) i oczywiście rozumieć samą ideę testów statystycznych (pojęcia takie jak: poziom istotności, p-value, błąd pierwszego rodzaju, itd.).

Test jest przewidziany na 90 minut. Za błędne odpowiedzi nie będzie punktów ujemnych. Na ocenę końcową wpływ mają również punkty z aktywności.

Życzę powodzenia!
Paweł Cibis