

Základy ekonometrie

Požadavky na látku k průběžnému testu

- *Lineární regresní model a MNČ.* Odhad LRM v Gretlu, zápis odhadnuté regresní funkce, správná interpretace odhadnutých parametrů (včetně modelů s logaritmy, interakcemi a druhými mocninami), intervalové odhady regresních koeficientů (v Gretlu i ručně), interpretace R^2 .
- *Gaussovy-Markovovy předpoklady.* Vyjmenování G-M předpokladů, příklady modelů, ve kterých nejspíš nebudou splněny (vynechání podstatné proměnné, heteroskedasticita, perfektní multikolinearita), důsledky porušení G-M předpokladů na statistické vlastnosti MNČ.
- *Statistické vlastnosti MNČ.* Nestranost, konzistence, vydatnost (= eficeience, BLUE vlastnost) a jejich praktická interpretace. Rozdělení standardizovaných odhadů pořízených MNČ při malém a velkém rozsahu výběru.
- *Heteroskedasticita.* Statistické testy heteroskedasticity¹ (teorie i praktické provedení v Gretlu), postup při odhadu modelu vykazujícího heteroskedasticitu.
- *Multikolinearita.* Měření síly lineární závislosti mezi vysvětlujícími proměnnými pomocí VIF.
- *Testování hypotéz.* Správná formulace hypotéz na základě ekonomického zadání (včetně předchozí volby vhodného regresního modelu), ruční vyhodnocení t -testů při zadané odhadnuté regresní funkci a směrodatných chybách, vyhodnocení t -testů i F -testů v Gretlu (všechny varianty testů zmíněné v dodatku pdf materiálu ke cvičením).
- *Cobbova-Douglasova produkční funkce.*

¹ Probírali jsme pouze parametrické testy (konkrétně Whiteův a Breuschův-Paganův), ostatní testy nebudou vyžadovány.