

EKONOMSKI FAKULTET UNIVERZITETA U BEOGRADU
MASTER: KVANTITATIVNA EKONOMIJA/EKONOMETRIJA
PREDMET: PRIMENJENA ANALIZA VREMENSKIH SERIJA
GODINA: 2015
PREDAVAČ: ZORICA MLADENOVIĆ

Teme za pripremu ispita:

1. Uslov stabilnosti VAR modela. Uslov stabilnosti VAR(1) modela.
2. Ocene parametara dobijene ONK metodom u VAR modelu.
3. Ocena kovarijacione matrice slučajnih greški primenom metoda maksimalne verodostojnosti.
4. Primena testa količnika verodostojnosti u determinisanju optimalnog reda VAR modela.
5. Specifikacija VAR modela: višedimenzionalni informacioni kriterijumi, testovi autokorelacije i normalnosti.
6. Definicija i testovi uzročnosti. Ekonomski ilustracija.
7. Definicija funkcije impulsnog odziva. Ekonomski primer.
8. Ortogonalna funkcija impulsnog odziva: Holeskijeva dekompozicija.
9. Definicija dekompozicije varijanse greške predviđanja.
10. Primer dekompozicije varijanse greške predviđanja na VAR modelu dimenzije 2. Ekonomski ilustracija.
11. Veza VAR modela i kointegriranog sistema. Vektorska forma modela sa korekcijom ravnotežne greške.
12. Vektorska MA reprezentacija nestabilnog sistema.
13. Veza reprezentacije zajedničkih trendova i kointegriranog sistema.
14. Kointegracija u dvodimenzionom prostoru. Engle-Grejndžerova procedura.
15. Grejndžer-Johansenova teorema reprezentacije (sa primerima).
16. Johansenovi testovi kointegracije: izvođenje forme testova i objašnjenje algoritma testiranja.
17. Ocena kointegriranog VAR modela primenom metoda maksimalne verodostojnosti: osnove i izvođenje u grubim crtama.
18. Determinističke komponente u kointegriranom VAR modelu.
19. Linearna ograničenja na kointegracione parametre: različite formulacije ograničenja i definisanje odgovarajućih test-statistika. Ekonomski ilustracija.
20. Linearna ograničenja na parametre prilagođavanja. Test slabe egzogenosti u kointegriranom sistemu. Parcijalni kointegrirani model.
21. Identifikacija kointegracionog prostora: osnovna ideja i ekonomski ilustracija.