

Teme za pripremu ispita

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