

PROJEKT Z EKONOMETRIE 2006/2007

- Cieľom projektu je ekonometrická analýza zvoleného ekonomického modelu.
- Napriek tomu, že v priebehu semestra budeme mať aj niekoľko príkladov, v ktorých budeme pracovať s časovými radmi, tento kurz ekonometrie nie je zameraný na časové rady. Pri modelovaní časových radov sa používajú aj preberané metódy (treba však vedieť, kedy sa môžu použiť), ale aj špeciálne metódy pre časové rady. Preto použite v projekte prierezové dáta
- Projekt môžete robiť samostatne alebo v dvojiciach. Každý projekt modeluje iné dáta.
- Model môže byť: model z ekonomickej teórie, model študovaný v článku v ekonomickom / ekonometrickom / štatistickom časopise, vlastný model - s vysvetlením, prečo by vysvetľujúce premenné mali mať vplyv na vysvetľovanú premennú modelu
- Nemôže to byť: analýza dát z učebnice ekonometrie, domácich úloh, a pod. identity typu $Y=C+G+I+NX$ (to je definícia HDP, nie model, ktorý ho vysvetľuje pomocou iných premenných)
- Obsah projektu:
 - Úvod. Popis modelu z teórie, na ktorom je ekonometrický model založený. Ak ide o vlastný model, vysvetlite, akú závislosť očakávate a prečo.
 - Dáta: zdroj, popis.
 - Formulácia regresného modelu. Odhady parametrov, ich signifikancia, signifikancia regresie. Koefficient determinácie. Porovnanie s ekonomickou teóriou, resp. očakávanou závislosťou.
 - Overenie predpokladov modelu: testovanie heteroskedasticity, normality rezíduí.
 - Problém multikolinearity.
 - Ak zistíte, že niektorý predpoklad regresného modelu nie je splnený: Ak treba, korekcia predchádzajúcich testov signifikancie. Vysvetlite, čo spravíte pre zabezpečenie korektnosti ďalšej analýzy. Inou možnosťou je preformulovať model tak, aby v novom modeli boli predpoklady splnené.
 - Samostatne vymyslíte, čo by bolo zaujímavé s vašim modelom robiť. Napríklad:
 - * Ak zistíte heteroskedasticitu, skúste nájsť premennú, ktorá ju spôsobuje.
 - * Testujte hypotézu o parametroch modelu, ktorá má ekonomickú interpretáciu.
 - * Vytvorte dve skupiny dát a testujte, či sú v nich parametre modelu rovnaké. Vysvetlite, prečo ste dáta rozdelili takýmto spôsobom, prečo by v týchto skupinách mohli byť parametre rôzne.
 - * ...
 - Záver: zhrnutie výsledkov.
- Pri všetkých testoch píšete nulovú hypotézu, použitý test, jeho výsledok a interpretáciu.
- Odovzdávanie projektov:
 - Termín odovzdania je 11.5.2007 (piatok)
 - Projekt (v pdf, prípadne doc formáte) a dáta (v textovom súbore) pošlite mailom na bs.projektygmail.com.
- Hodnotenie:
 - 0-20 bodov, 20 bodov je za projekt spĺňajúci všetky uvedené požiadavky na obsah, so správnym použitím ekonometrických metód.

- Body budú zverejnené na stránke pred skúškou.
- Otázky (výber dát, modelu, testy, ...) - mailom (bs.projektygmail.com) alebo si dohodneme osobné stretnutie.