

## CVIČENIA Z EKONOMETRIE 2004/2005

### PROJEKT

Cieľom projektu je ekonometrická analýza vybraného ekonomického modelu. Pracovať môžete samostatne alebo v dvojiciach. Termín odovzadnia projektu je 20.5.2005.

#### **Výber modelu**

- Môže ísť o model z ekonomickej teórie (využite vaše vedomosti z mikroekonómie a makroekonómie, námety môžete získať aj z učebníc v knižnici).
- Inou možnosťou je zopakovať analýzu z nejakého článku.

#### **Ďalšie poznámky**

- Odporúča sa používať radšej prierezné dáta ako časové rady.
- Niekoľko odkazov na stránky s článkami a dátami je na stránke predmetu.
- Regresia musí byť významná (F štatistika) - aby malo zmysel robiť ďalšiu analýzu modelu, musí byť medzi skúmanými premennými nejaký vzťah.

#### **Obsah projektu**

- Formulácia modelu.
- Dáta (popis, zdroj).
- Odhad parametrov modelu, ich významnosť, významnosť regresie.
- Testovanie hypotéz o koeficientoch, ak majú ekonomickú interpretáciu.
- Heteroskedasticita.
- Multikolinearita.
- Normalita rezíduí.
- Pri časových radoch testovanie konštantnosti koeficientov, autokorelácie.
- Prípadné porovnanie s alternatívnym modelom.
- Záver.