

Makrometrija_Analiza vremenskih serija_teorijska (kratka) pitanja

1. Vrste podataka.
2. Vremenska serija.
3. Razlika statističkog zaključivanja i AVS.
4. Autokorelacija.
5. Osnovna razlika između klasičnog ekonometrijskog pristupa i pristupa AVS.
6. Ključna svojstva ekonomskih VS.
7. Trend.
8. Sezonska komponenta VS.
9. Strukturni lom.
10. Osnovne oznake u AVS.
11. Stacionarnost vs. nestacionarnost.
12. Stroga vs. slaba stacionarnost.
13. Beli šum.
14. Gausov beli šum.
15. Osnovni modeli stacionarnih VS.
16. Autoregresioni modeli - AR. AR(1), AR(2),... AR(p).
17. Modeli pokretnih proseka - MA. MA(1), MA(2),... MA(q)
18. Autoregresioni modeli pokretnih proseka - ARMA.
19. ARIMA(p,d,q).
20. Obični autokorelacioni koeficijent / autokorelaciona funkcija / korelogram.
21. Parcijalni autokorelacioni koeficijent / autokorelaciona funkcija / korelogram.
22. Opšti oblik obične (AC) i parcijalne autokorelacione funkcije (PAC) AR modela.
23. Opšti oblik obične (AC) i parcijalne autokorelacione funkcije (PAC) MA modela.
24. Testiranje autokorelacije. Nulta i alternativna hipoteza, pravilo odbacivanja/prihvatanja nulte hipoteze.
25. Koraci u AVS.
26. Statistički razlozi podele VS na stacionarne i nestacionarne.
27. Ekonomski razlozi podele VS na stacionarne i nestacionarne.
28. Slučajni hod.
29. Uslov stacionarnosti kod AR(1) modela.
30. Proces/ red integrisanosti. $X_t \sim I(0)$ i $X_t \sim I(1)$.
31. Objasniti: $X_t \sim I(d) \leftrightarrow \Delta^d X_t \sim I(0)$.
32. Dickey-Fuller-ov (DF) test jediničnog korena. Polazni model. Hipoteze. Pravilo odlučivanja.
33. DF test za različite determinističke komponente: $\tau - \tau_{\mu} - \tau_{t}$.
34. Određivanje broja jediničnih korena
35. KLRM kao okvir za analizu međuzavisnosti nestacionarnih VS
36. Koncept kointegracije
37. Model sa korekcijom ravnotežne greške (ECM)
38. Pozitivna/negativna ravnotežna greška i parametar prilagođavanja u ECM
39. Koraci u empirijskoj analizi međuzavisnosti nestacionarnih VS

40. Osnovna svojstva VAR modela
41. Dimenzija i red VAR modela
42. Specifikacija VAR modela: determinističke komponente
43. Specifikacija VAR modela: red modela
44. Specifikacija VAR modela: vektorske VS sa jediničnim korenom
45. Funkcija impulsnog odziva
46. Dekompozicija varijanse greške predviđanja