

Analityka gospodarcza – pytania na egzamin magisterski

1. Podstawowe metody estymacji w ekonometrii.
2. Kryteria wyboru modelu ekonometrycznego.
3. Oczekiwania i sposoby ich odzwierciedlenia w modelu ekonometrycznym.
4. Integracja i kointegracja zmiennych – pojęcie, konsekwencje i sposoby odzwierciedlenia w modelu ekonometrycznym.
5. Testy pierwiastka jednostkowego i stacjonarności.
6. Modele szeregów czasowych ARMA, ARIMA i SARIMA – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
7. Liniowe modele ze zmiennymi w czasie parametrami – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
8. Modele ARCH i GARCH – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
9. Modele zmiennych jakościowych dwumianowych i wielomianowych uporządkowanych – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
10. Modele zmiennych wielomianowych nieuporządkowanych – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
11. Modele wielorównaniowe – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
12. Model VAR dla zmiennych stacjonarnych – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
13. Model VAR dla zmiennych niestacjonarnych – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
14. Statyczne modele panelowe – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji. Zastosowania w modelowaniu relacji ekonomicznych.
15. Modelowanie i prognozowanie procesów gospodarczych.
16. Efektywność rynków finansowych i sposoby jej weryfikacji.
17. Własności stóp zwrotu z instrumentów finansowych i ich diagnozowanie.
18. Prognozowanie stóp zwrotu z instrumentów finansowych.
19. Analiza zdarzeń – istota, metody, zastosowanie w modelowaniu procesów finansowych.
20. Podstawowe modele równowagi makroekonomicznej i wzrostu gospodarczego.
21. Metody prognozowania wybranych kategorii makroekonomicznych.
22. Testowanie stabilności prognostycznej modeli.
23. Metody symulacyjne w modelowaniu i prognozowaniu relacji ekonomicznych.
24. Działanie prawa jednej ceny w gospodarce i sposoby jego weryfikacji.
25. Czynniki wyceny – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji.
26. Szacowanie i prognozowanie ryzyka instrumentów finansowych oraz portfeli z nich złożonych.
27. Pomiar konkurencyjności na szczeblu makroekonomicznym i regionalnym.
28. Wielokryterialne modele decyzyjne i ich zastosowanie.
29. Programowanie całkowitoliczbowe. Istota i zastosowania.
30. Modele sieciowe – istota, rodzaje, zastosowania w zarządzaniu organizacjami gospodarczymi.