

Analityka gospodarcza – pytania na egzamin licencjacki

1. Klasyczny model regresji liniowej – postać, składowe, interpretacja parametrów strukturalnych.
2. Klasyczny model regresji liniowej – założenia numeryczne i stochastyczne oraz konsekwencje ich niespełnienia.
3. Estymacja modelu metodą najmniejszych kwadratów – istota, własności estymatorów uzyskanych za jej pomocą.
4. Testy diagnostyczne wykorzystywane w ocenie modelu ekonometrycznego.
5. Testowanie hipotez odnoszących się do parametrów strukturalnych modelu ekonometrycznego.
6. Miary dopasowania modelu ekonometrycznego do danych empirycznych.
7. Estymacja i walidacja modelu ekonometrycznego w wypadku heteroskedastyczności lub autokorelacji błędów pomiarowych.
8. Zmienne zero-jedynkowe i ich wykorzystanie w modelowaniu ekonometrycznym.
9. Dynamiczny jednorównaniowy model ekonometryczny – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji.
10. Modele szeregów czasowych typu ARMA.
11. Pojęcie prognozy i rodzaje prognoz.
12. Mierniki dokładności prognoz ex-post.
13. Adaptacyjne metody prognozowania.
14. Pojęcie i zadania prognoz koniunkturalnych.
15. Wielorównaniowe modele ekonometryczne – rodzaje, metody estymacji.
16. Liniowy model decyzyjny i metody jego rozwiązania.
17. Dualizm w programowaniu liniowym.
18. Zagadnienie transportowe i metody jego rozwiązania.
19. Zagadnienie przydziału i metody jego rozwiązania.
20. Programowanie dynamiczne.
21. Rozwiązywanie sytuacji konfliktowych – gry dwuosobowe o sumie zerowej.
22. Podejmowanie decyzji w warunkach niepewności i ryzyka.
23. Modele popytu konsumpcyjnego – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji.
24. Modele procesu produkcji w makroskali – problemy specyfikacji, estymacji i walidacji.
25. Portfel papierów wartościowych – metody konstrukcji, mierniki oceny efektywności.
26. Metody i możliwości dywersyfikacji ryzyka na rynku finansowym.
27. Fundusze inwestycyjne – pojęcie, rodzaje, rola i znaczenie w gospodarce.
28. Model Sharpe'a – problemy specyfikacji i estymacji. Zastosowania w analizach instrumentów finansowych.
29. Analiza techniczna papierów wartościowych – założenia, metody, zastosowania.
30. Analiza fundamentalna papierów wartościowych – założenia, metody, zastosowania.