

FRAGEN ZUM TEST AUS Angewandter Ökonometrie, WS21/22

Wie lautet das ADL(1,1), wie das daraus hergeleitete Fehlerkorrekturmodell?

Wie groß ist im ADL(1,1) der 1-Perioden Multiplikator der erklärenden Variablen, wie groß der langfristige Multiplikator?

Wie groß ist die durchschnittliche Verzögerung bei einer einmaligen Veränderung in Y?

$$\hat{C}_t = -3 + 0.8 C_{t-1} + 0.2 Y_t$$

Nennen sie verschiedene Erwartungsmodelle.

Geben sie ein Beispiel für ein Anpassungsmodell.

Was ist eine Quasidifferenz und wozu wird sie verwendet?

Der DW-Test auf Autokorrelation 1.Ordnung ist für Modelle mit gelagkten endogenen Variablen nicht geeignet. Welche Tests kann man stattdessen verwenden?

Gegeben sind 100 potenziell erklärende Variable für eine abhängige. Wie finden sie in einer vertretbaren Zeit ein brauchbares Modell?

Gegeben sind zwei I(1) Prozesse, X_t und Y_t .

(a) Was muss erfüllt sein, damit sie kointegriert bzw. nicht-kointegriert sind?

(b) Beschreiben sie die Schritte des Engle-Granger-Verfahrens zum Testen auf Kointegration?

Interpretieren sie das ECM für 2 kointegrierte Variable C und Y.

$$\Delta \hat{C}_t = -0.4[C_{t-1} + 1 - 0.8 Y_{t-1}] - 0.3 \Delta C_{t-1}$$

In Mehrgleichungsmodellen können verschiedene Gleichungs- und Variablen-Typen unterschieden werden. Welche?

Ein Macro-Modell lautet:

$$C = a + b*Y + u$$

$$I = d + e*Y + v$$

$$Y = C + I + G$$

Sind alle Gleichungen identifiziert? Überprüfen sie die Ordnungs- und die Rangbedingung.

Erklären sie die Idee der SUR. (Beschreiben sie das Modell, die Zusammenhänge die zwischen den Gleichungen bestehen und die Kovarianzmatrix der Störterme.)

Der simultaneous equation bias wird durch das Fehlen der Unkorreliertheit einer erklärenden Variablen mit dem Störterm verursacht, da diese erklärende Variable zugleich endogene Variable in einer anderen Gleichung ist.

Formal gilt für das Modell $y = X\beta + u$ mit $b = (X'X)^{-1} X'y$,

$$E(b) = \beta + (X'X)^{-1} X'u$$

Ist $X'u$ nicht 0, so ist b verzerrt.

Welche Lösung haben wir für dieses Problem diskutiert? Welche Nachteile treten möglicherweise auf.

Vergleichen sie ihre Prognose vom Jänner 2021 zum BIP Wachstum für Ö für 2021 mit der letzten WIFO/IHS-Prognose für 2021.

Geben sie ihren Prognosewert an und berechnen sie den RMSE.

Was sind die aktuellen Wachstums- und Inflationsprognosen für 2021 für Österreich und ER18.

Ad AT.wf1:

Wie groß ist das Wachstum pro Kopf seit 2000?

Beschreiben sie den Verlauf des Anteils der Investitionen am GDP für Ö.

Empirie der Konsumfunktion für Ö.

Sie haben mehrere Varianten einer Konsumfunktion für Ö geschätzt.

Kommentieren sie das Ergebnis.

Geben sie ein Beispiel eines stationären VAR(1) mit Dimension 2.

Geben sie ein Beispiel eines VECM der Dimension 2, in dem beide Variable kointegriert (es gibt genau eine Kointegrationsbeziehung) sind.

Welche Beziehung besteht zwischen der Anzahl der von null verschiedenen Eigenwerte der Π Matrix in der Granger representation eines VECM und der Anzahl der kointegrierenden Beziehungen in einem System.

Beschreiben sie den Ablauf und das Konzept des Max-Eigenvalue Tests auf Kointegration.