

Konwersatorium "Zaawansowana ekonometria"

Jerzy Mycielski

UW

2013

- Modele długości trwania
- Modele zapisane w przestrzeni stanów
- Regresja przełącznikowa i Markov switching models (MSM)
- Uogólniona Metoda Momentów
- Szacowanie modeli dynamicznych na danych panelowych
- Badanie integracji i kointegracji na panelach
- Metodologia Bayesowska, estymacja i wnioskowanie

- Regresja na kwantylach
- Zaawansowane modele selekcji i modele dla zmiennych dyskretnych
- Uogólnione modele liniowe (GLM)
- Metody nieparametryczne
- Propensity score matching (PSM)
- Regression discontinuity design
- Metoda Monte Carlo i Metoda Bootstrap (bez prezentacji)

- Zajęcia mają charakter konwersatoryjny
- Do każdego tematu będzie krótki wstęp teoretyczny
- Poza tym będą prezentowane artykuły z tematyki
- Obecność na zajęciach jest obowiązkowa

- W zależności od oceny:
 - 3 przygotowanie na egzamin 3 artykułów anglojęzycznych z trzech różnych tematów z zakresu wykładu i przygotowanie się do odpowiedzi ustnej z zakresu wybranych tematów oraz prezentacja na zajęciach jednego z wybranych artykułów
 - 4 napisanie 5 stronicowego streszczenia przeczytanego artykułu
 - 5 dodatkowo przeprowadzenie badania empirycznego analogicznego do tego przeprowadzonego w jednym z przeczytanych artykułów - 10 stronicowa praca zawierająca
 - hipotezę badawczą i streszczenie artykułu, na podstawie którego została przeprowadzona estymacja
 - wyniki estymacji
 - interpretację wyników i wnioski
 - 2 anloglojęzyczne pozycje bibliograficzne z tematyki badania
- Napisane streszczenia i opisy wyestymowanych modeli proszę przesać mailem przed rozpoczęciem sesji egzaminacyjnej.