

Specifikace požadavků ke zkoušce z teorie ekonometrie II

Ze zaslanych podkladových materiálu **nebudou předmětem zkoušení**:

a) část P14

Alternativní metody k (obyčejné) metodě nejmenších čtverců OLS, zejména metoda nejmenších absolutních odchylek **LAD** (Fairovy algoritmy) .

b) část P8

odvození LIML– odhadové funkce (předmětem zkoušení budou případně jen vlastnosti metody a základní princip vyvození LIML-estimátoru)

c) část P13

problematika testů založených na maximalizaci věrohodnostní funkce, tj. Waldův test, test věrohodnostního poměru a test Lagrangeových multiplikátorů

d) část P12

tématika nelineárních modelů a s nimi spojených odhadových funkcí (NL2S, NLIV, NLLI a ostatních) a numerických iteračních metod.

e) část P15

problematika chybné specifikace modelu