



UNIUNEA EUROPEANĂ
Fondul Social European



Ministerul Finanțelor Publice
Comisia Națională de Prognoză



GUVERNUL ROMÂNIEI
Ministerul Administrației și Internelor



Inovație în administrație
Programul Operațional
"Dezvoltarea Capacității Administrative"

TEMATICA ECONOMETRIE NIVEL DE COMPLEXITATE 2

Introducere în econometrie

- *tipuri de date*
- *metodologia analizei econometrice*
- *interfata programului Eviews*

Noțiuni privind teoria probabilităților

- *eveniment și probabilitate*
- *tipuri de variabile aleatoare, repartiția unei variabile aleatoare*
- *analiza distribuțiilor în Eviews*

Noțiuni privind statistica matematică

- *comportament asimptotic*
- *estimare, tipuri de estimatori*
- *teste statistice*
- *estimare și testare statistică în Eviews*

Modelul clasic de regresie liniară

- *ipotezele modelului clasic de regresie*
- *estimatorul OLS: proprietăți*
- *inferența statistică a modelului clasic de regresie*
- *estimarea și interpretarea rezultatelor unei regresii în Eviews*

Abateri de la ipotezele modelului clasic de regresie I

- *heteroskedasticitate, estimare robustă de tip White*
- *estimator WLS*
- *autocorelare, estimare robustă de tip Newey-West*
- *estimare robustă în Eviews*



UNIUNEA EUROPEANĂ
Fondul Social European



Ministerul Finanțelor Publice
Comisia Națională de Prognoză



GUVERNUL ROMÂNIEI
Ministerul Administrației și Internelor



Inovație în administrație
Programul Operațional
"Dezvoltarea Capacității Administrative"

Abateri de la ipotezele modelului clasic de regresie II

- *problema de endogenitate*
- *variabile „proxy”*
- *variabile instrumentale*
- *metoda de estimare TSLS*
- *modele cu ecuații simultane: forma structurală și forma redusă*
- *estimare in Eviews*

Tehnici de modelare și previzionare a seriilor de timp unidimensionale

- *procesele de tip AR(1), AR(2), MA(1), MA(2), ARMA*
- *metodologia Box-Jenkins*
- *estimarea proceselor ARMA in Eviews*
- *prognoza bazata pe modele ARMA*
- *stationaritate, teste de „unit root”, modele ARIMA*
- *testarea staționarității in EViews*

Tehnici de modelare și previzionare a seriilor de timp multidimensionale

- *procesele de tip VAR(1)*
- *funcții de răspuns la impuls*
- *prognoza bazata pe modele VAR*
- *cauzalitate Granger*
- *estimarea și analiza modelelor VAR in Eviews*

Tehnici de analiza a dinamicii pe termen lung a variabilelor economice

- *teste de cointegrare*
- *modele de tip VEC*
- *estimarea și analiza relațiilor pe termen lung in Eviews*

Tehnici de analiză a modelelor de tip panel data

- *metode de estimare*
- *estimarea modelelor cu date panel in Eviews*

Tehnici de estimare a modelelor de tip DSGE

- *structura de baza a unui program tip Dynare*
- *log-liniazarea unui model DSGE*