

Povzetek

Osrednja tema diplomskega dela je ocenjevanje parametrov po posplošeni metodi momentov. V prvem poglavju najprej na kratko opišem ocenjevanje linearnega modela po metodi najmanjših kvadratov ter lastnosti in pomanjkljivosti te metode.

V drugem poglavju je predstavljena metoda ocenjevanja parametrov z instrumentalnimi cenilkami, ki je pravzaprav izboljšava metode najmanjših kvadratov, saj z uvedbo instrumentalnih cenilk dobimo dodatne pogoje za oceno parametrov.

Metoda ocenjevanja z instrumentalnimi spremenljivkami je poseben primer posplošene metode momentov na linearnih modelih. Omenjeno metodo diplomsko delo obravnava v tretjem poglavju. Predstavljena je formulacija posplošene metode momentov, njene lastnosti in implementacija.

V zadnjem poglavju obravnavam konkreten primer uporabe posplošene metode momentov pri ocenjevanju vpliva šolanja na placo. Zanima nas, kako je višina urne place odvisna od posameznikove izobrazbe in sposobnosti.

Diplomskemu delu sem dodala še kratek povzetek uporabljene verjetnostne in statistične teorije.

Math. Subj. Class. (MSC 2000): 60F05, 60G07, 62F10, 62P20

Ključne besede:

model, vzorec, cenilka, slučajna spremenljivka, slučajni proces, stacionarnost, ergodicnost, centralni limitni izrek, zakon velikih števil, metoda najmanjših kvadratov, endogenost, eksogenost, instrumentalna spremenljivka, metoda momentov, posplošena metoda momentov, asimptotična teorija, doslednost, pristranskost, optimalnost, asimptotična normalnost

Keywords:

mode, sample, estimator, random variable, random process, stationarity, ergodicity, central limit theorem, law of large numbers, ordinary least squares, endogeneity, exogeneity, method of moments, instrumental variable, generalized method of moments, asymptotical theory, consistency, bias, optimality, asymptotical normality

Literatura

- [1] <http://www.econ.kuleuven.ac.be/gme/>.
- [2] J. W. Demmel. *Uporabna numerična linearna algebra*. DMFA, 2000.
- [3] W. H. Greene. *Econometric Analysis*. Prentice Hall, 5th edition, 2003.
- [4] A. R. Hall. *Generalized Method of Moments*. Oxford University Press, 2005.
- [5] F. Hayashi. *Econometrics*. Princeton University Press, 2000.
- [6] R. Jamnik. *Matematična statistika*. DZS, 1980.
- [7] R. Jamnik. *Verjetnostni račun in statistika*. DMFA, 1986.
- [8] J. G. MacKinnon R. Davidson. *Econometric Theory and Methods*. Oxford University Press, 2004.
- [9] M. Verbeek. *A Guide to Modern Econometrics*. Wiley & Sons, 3rd edition, 2008.
- [10] W. T. Vetterling W. H. Press, S. A. Teukolsky. *Numerical Recipes: The Art of Scientific Computing*. Cambridge University Press, 3rd edition, 2007.
- [11] W. M. Wooldridge. *Introductory Econometrics: A Modern Approach*. Thomson Learning, 3rd edition, 2005.