

# Povzetek

Diplomsko delo obravnava posplošeno metodo momentov. V prvem poglavju so najprej predstavljeni osnovni pojmi matematične statistike, ki jih potrebujemo v nadaljevanju pri obravnavi posplošene metode momentov. Tukaj spoznamo metodo najmanjših kvadratov kot najbolj razširjeno cenilko regresijskih koeficientov na majhnih vzorcih in pa teorijo velikih vzorcev.

Drugo poglavje pokriva formulacijo posplošene metode momentov, ki zagotavlja rešitev ocenjevanja modela z endogenimi regresorji. Predstavljeni so postopki za tak model, lastnosti posplošene metode momentov kot cenilke za velike vzorce in z njo povezane testne statistike.

Na koncu, v tretjem poglavju, je naveden obsežnejši primer uporabe posplošene metode momentov, kjer ocenjujemo enačbo plače. Zanima nas, kako je velikost plače odvisna od izobrazbe in sposobnosti posameznika. Ugotovimo, da so regresorji endogeni, zato uporabimo metode ocenjevanja, predstavljene v drugem poglavju.

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

**Ključne besede:**

model, vzorec, cenilka, slučajni proces, ergodičnost, metoda momentov, endogeni regresorji, instrumenti, testna statistika

**Keywords:**

model, sample, estimator, stochastic process, ergodicity, method of moments, endogenous regressors, instruments, test statistic

# Literatura

- [1] Hayashi, Fumio: *Econometrics*, Princeton University Press, Princeton and Oxford, 2000
- [2] Verbeek, Marno: *A Guide to Modern Econometrics*, John Wiley & Sons, Ltd, 2nd edition, Chichester, 2004
- [3] Kreyszig, Erwin: *Introductory Mathematical Statistics: Principles and Methods*, John Wiley & Sons, Inc., United States of America, 1970
- [4] Jamnik, Rajko: *Matematična statistika*, Državna založba Slovenije, Ljubljana, 1980
- [5] Grimmett, G. R. and Stirzaker, D. R.: *Probability and Random Processes*, Clarendon Press, 2nd edition, Oxford, 1997
- [6] Durrett, Richard: *Probability: Theory and Examples*, Duxbury Press, 2nd edition, Belmont, 1996
- [7] Pfajfar, Lovrenc: *Ekonometrija 1. del*, Ekonomska fakulteta, 3. izdaja, Ljubljana, 1998
- [8] Sarapa, Nikola: *Teorija verojatnosti*, Školska knjiga, Zagreb, 1987
- [9] Billingsley, Patrick: *The Lindeberg-Lévy Theorem for Martingales*, Proceedings of the American Mathematical Society, 12, 788 - 792, 1961.