Exam.Code:0310 Sub. Code: 2684

(15)

1057

M.A (Economics)-4th Semester MAECO-403 & 404 [Opt. (v)]: Advanced Econometrics (In all mediums)

Time allowed: 3 Hours Max. Marks: 80

NOTE: Attempt five questions in all, including Question No. I which is compulsory and selecting one question from each Unit. Use of Non-Programmable Non-scientific calculator is allowed.

**_*_

- I. Attempt any ten of the following: -
 - (a) What do you mean by misspecification of model?
 - (b) Define Encompassing model.
 - (c) What do you mean by a dummy variable?
 - (d) Differentiate between intercept and slope dummy variables.
 - (e) What do you mean by marginal effect at mean under logit estimation framework?
 - (f) Define Pseudo-R².
 - (g) How Logit model is different from Probit model.
 - (h) Explain Tobin's Probit model.
 - (i) What do you mean by under identification of model?
 - (j) What is the significance of rank condition of identification?
 - (k) When ILS, 2SLS and 3SLS produce same results?
 - (1) What do you mean by correlogram?
 - (m) Differentiate between Dickey Fuller and Augmented Dickey Fuller Regression equations.
 - (n) Present a tri-variate VAR in matrix form.
 - (o) How will you differentiate pooling techniques with panel data techniques?

UNIT-I

- II. Discuss various consequences of specification error.
- III. Show that how dummy variables can be used to test the structural shift in the parameters of a regression model? (15)

UNIT-II

- IV. Discuss the relationship between Logit and Probit models. Also discuss method to estimate the marginal effects of Probit model. (5+10)
- V. Why do the researcher need Tobit estimation when the dependent variable is a censored variable? What is the difference between censored and truncated variable models? (7+8)

UNIT-III

- VI. Write a suitable just identified model and derive the ILS estimators of structural parameters. (5+10)
- VII. Define 3SLS method of estimating a SEM. Why issue of heteroscedasticity emerges in SEM and use of 3SLS preferred over 2SLS? (8+7)

UNIT-IV

- VIII. What is autocorrelation? How the two concepts autocorrelation and non-stationarity are related? What is the difference between stationary, drift stationary, and trend stationary series? (5+5+5)
- IX. Differentiate between fixed effect and random effect methods of estimating parameters of a panel data regression model. How Hausman test helps to make selection between two models? (10+5)

* * *

10

T

A

निमालिकित के के भी (10 प्रवनों के उत्तर बीजिए। (10xx साइल के मलत विशेष विकाश के करे के अभाग कहा ज्यातम् भाउल के प्रमात है। रिक्वावडी नार आहेर में कर के आप का लानते हैं। 4 अनुमात्म भीर रिस्नावरी डोकिट हलती। चर रामिया भू में अन्तर मण्डर क्रीनिक्टी भू अनुमानिस हांचे के अन्तमस स्मेस्ट पर मामुसी Forty हारडा और किशान साडिय में अन्य स्विक्ध्री क्रिक्स के बाद में आप कहा त्याच्य है,3 के अने माने हैं का कहा त्याचे भूति के मोनेश्री 18 1 St MASING A FETTE FALOR OF WIGHT महत्यान की केंद्र करेंग्रेशन के को महस्म है? 3) पड़ रहि के उरा कर मेर के वरितास (& FITE 15 The Fra & masgalarro Dickey Fuller sit Augmented Dobay Fuller-Regression Hitheren It 34-02 FUEL FSI 3

Posting that it, soul date dutation it I- 814E विशेष क्या में पांचे जम आकी अगृद्धि के विश्वीक परिवासी (15) रिक्ट क्या करें। रिक्ट क्या के पांचे जम आकी अगृद्धि के विश्वीक परिवासी त्यास्या भीकित। भारता हन्त्यास्यक स्थिति से सेसेस्टिय से अस्टिश्व (1) Logit of Crops THEOR I Start Hand the Hood

The respondent with the SAN stoner is

प्रमाल के द्वार प्रमाल के स्वरंत के महिला के महिला के महिला के स्वरंत के स्वरं IM- = XXE

जीचेत एवं डीफ समाख्त (प्रामाम) मिए मक्त देवार में लिखें के बार के किरहा।

SEW I SURENT & BSIS (STORE IT TOPE of 1 SEW of Actoroxedanticity में मुद्दा मनी मिता होता है जो रडाड की अवेहर उडाड के प्रयोग के की प्राथमिका 28 pm 2

3年13-7 अधिया, म. अन्य नर्राट सुन। आप्रीकाम (अन्यय) सवाहा (ज्ञ्यासा) कुर स्टीय आप्राची स्पाद क्या है। अवतार्या में क्या अवता है। अन्द्रा सुद्धियां क्या है। अद्मिसी स्पाद्धियां कुर

y the safe bediernon wages of material of men ड्रीमी साहत, से जात्रच के यहात्रचा मंद्रवाहर हे (10'2)

(राधाम - इंडाखर) । होते होते हे महक्रा हिसे हेने 10 महत्या हिता हिंदी

श्री देशान के क्षेत्र है।

Brendo-63 & ry 3ct. 1 of the state of the titles from I sent F 19

2 12

5)

4 4

Legat mit legate to a man of man of man of man of the form of the first state of the property of the first state of the property of the first of the property of the property

when & saw (imperes EE) estate value ग्रह्म क्षेत्र।

Pooling mit Panel data 32 Har Form & Now 201

T

T

IT

15

स्टिंग हे हे हे होता है से उसे में माना है हिमान हे में है में है मानहों है माना है हिमान है में है में मानी है होने होने माना है

II १ र महत्व मन स्थि डेमी हैंदे

15415 -- 51 tider The return to word tim tigal माडिक के प्रसिद्ध में अहं है अहमा है हिसा में SH SHEKE EE A BEHARM THOT & MAKE A Kimigh Ergel & Melin multer Esterment

किया प्रशास हार दीर दीर उंड-उन्ह ही सम्बाह M33 म्हार देश

an

(1/8)

(5,10°

स्थारी -1 विक्रमुक्त और मिकारमंदी भाउन क्षेत्रे मियो लाउ उत्तराउभर अध्यद्भे है। Ls m हमहत्री

SEM & mashes & 35 2 3 212 8 A 28 28 28 28 M 178, SEM For Reterorcedaticity & HETS उरार के इंडे. हैं जीकामिय सिर्टी हिंस सिरी हैं। बिर्ट ज़िंदा में भी आड़ करार के उससे हिंदा

LESGIES - TA -non four mortelerras own 5 the noiteless as out र्द्राह हिस्से क्रियाम में में प्राप्ति करा करणा क्रिया रहेल मेडी नामडीर्स हिरड्यू रील रिपड्रिय , करिरिए

Sand with the service were the rest of the service services by the service of the services of

X-x-X

X-x-x