

Komment á ritgerðir

25. mars 2025

- Guðni Þór Práandaron: Samanburður á vísitölum fyrir leigu og neyslu. Það er nauðsynlegt að allar skilgreiningar á hugtökum komi vel fram. Hvað er leiga og neysla og hvernig er það mælt. Stórt R^2 er ekki endilega alltaf gott í tímaradagreiningu. VIF=variance-inflation-factor (minnir mig). Þetta hugtak þarf að skilgreina segja hvað það þýðir.
- Hilmar Ásgeirsson:Hamingja og efnahagur. Þetta verkefni virðist komið stutt á veg. Vitnað er til þess að nota eigi gögn frá „*World happiness report*“. Ekki kom fram hvaða breytur komi við sögu, né hvað væri mælt.
- Jökull Máni Óttarsson: Atvinnuleysi og verðbólga. Þetta er klassískt hagfræðiverkefni (Philips-kúrfan). Í praxís er til staðar skilgreiningar og mælingavandi. Hvað er atvinnuleysi? Er það leti eða illa smurður vinnu-markaður. Það er eðlilegt að reikna með árstíðasveiflu í atvinnuleysi en síður í verðbólgu. Það er spurning hvort eigi að túlka mælivandi eins og t.d. árstíðabundnar útsölur. Sjálffylgni-mælikvarðar eiga að segja sömu sögu með mismunandi gleraugum. Hvað þýðir að eitthvað sé meira normal en annað?
- Mónica Adjani Arnþórsdóttir: Umhverfisskattar og ETS. Hér þarf að skilgreina hvað eru umhverfisskattar. Eru þeir frábrugðnir sköttum á syndsamlegt líferni? Eru þeir skilvirk fjáröflunarleið fyrir hið opinbera. ETS er merkilegt pólitískt fyrirbæri. Hvers eðlis er ETS? Er þetta nýr gjaldmiðill?
- Sunna Xiao Björnsdóttir: Verðþróun málma í tíma. Skoðaðar eru 4 tímaraðir. Hafa í huga að málmar eru t.d. hráefni og/eða gjaldmiðlar. Hér þarf að segja hvaða tímabil eru skoðuð, hvaðan gögn koma o.s.frv.
- Valdís Ósk Árnadóttir: Skoðuð er þróun á hráoliuverði og gulli. Það er eðlismunur á þessum vörum olíu er aðallega brennt til að fá nauðsynlega orku. Gull er að miklu leyti gjaldmiðill og fjárfestingavara. Gera má ráð fyrir spákaupmennskueðli þessara markaða en spákaupmennskupátturinn er mismunandi í þessum vörum.

- Sara Mist Hafþórsdóttir: Vextir og húsnæði. Hér þarf að skilgreina hugtökin, hvað eru vextir, hvernig á að mæla húsnæðisverð ofl. Áhugavert að vita hvernig núvirðingarformúlur virka.
- Melkorka Ýr Bustos: Stýrivextir og húsnæðisverð. Hvað er meðalverð? Hvernig á að árstíðaleiðrétta? Verð á að logaritmera. Hvort eru húsnæðis kaup neysla eða fjárfesting?
- Björn Rúnar Kristinsson: Hitastig og verð á rafmagni: Margar tölur, eru það miklar upplýsingar? Hvernig á að árstíðaleiðrétta? Verð á að logaritmera. Hér eru ýmis konar ARCH/GARCH líkön áhugaverð. Jafnvel líkön sem leyfa hopp, sbr. kafla 6 í bók.
- Thelma Mist Oddsdóttir: Húsnæðisverð og barneignir. Húsnæði þarf að skipuleggja með þarfir í huga. Hugsanlega er samsetning eigna á markaði óheppileg þannig að hún svarar ekki þörfum (eftirspurn). Fylgnireikningar með tímaraðargögn eru varasamir. Það á ekki að taka of oft mismun. Ath. að VECM er ákveðin tegund af VAR.
- Alex Þór Júlíusson: Phillips kúrvan, samband verðbólgu og atvinnuleysis. Gagnatímabilið er 2003-2025. Hugsanlega er það of stutt tímabil því það er ekki nógu margir hagsveiflutoppar á tímabilinu. Hvernig á að árstíðaleiðrétta mánaðargögn? Það hefur heilmikið verið skrifað um „stagflation“.
- Aðalbjörg Helga Einarsdóttir: Fjöldi bíla og loftgæði: Hér þarf að huga að skilgreiningum. Hvað er fjöldi? Er það skráðir bílar eða bílar í umferð? Hvað eru loftgæði? Ef nota á gögn þarf að huga að gæðum þeirra.

- Benedikt Júlíus Steingrímsson: Stýrivextir og verðbólga. Hagfræðingar hafa lengi deilt um þetta. Hvernig á að meðhöndla neysluþátt þess að búa í eigin húsnæði (skoða Klevmarken, 2010). Hugleiða hvernig eigi að meðhöndla raðir þar sem mælitíðni er ójöfn.
- Finnur Breki Bjarnason: Samþætting bankahlutabréfa. Eins konar blanda af co-integration og pairs-trading. Gott að teikna leifaliði. Í margvíðu kerfi eiga leifaliðir að líkjast margvíðu hvítu suði. Þá getur verið upplýsandi að skoða covarians fylki leifaliða. Sú skoðun gæti greint hvort mæld fylgni raða er vegna þess að ein leiðir aðra eða hvort högginn komi samtímis á báðar (allar) jöfnurnar.
- Skorri Jónsson: Gini stuðull og bein fjárfesting. Hér þarf að skoða einingar, í hvaða einingur er FDI. Getur FDI verið negatívt? Notkun á Gini-stuðlum varasöm ef undirliggjandi breyta getur tekið neikvæði gildi.
- Elva Dögg Jónsdóttir: Verðvísitölur og útflutningstekjur. Hér er heppilegt að vinna í logaritnum. Hlutfallslegur breytileiki er áhugaverður. Fylgni-reikningar og R^2 eru varasöm í tímaröðum.
- Halldór Fryer Grettisson: Áhrif vikudag á ávöxtun á OMX. Það hefur mikið verið skrifað um trading-day áhrif. ARCH/GARCH er aðferðir til að kljást við breytileika sem gengur í gusum.
- Tryggvi Klemens Tryggvason: Breyting á VLF og atvinnuleysi í Þýskalandi. Gögn voru árstíðaleiðrétt. Veistu hvernig það var gert? Hér mætti kannski hugleiða einhvers konar variance-stabilizing-transform. Mér finnst að maður eigi ekki að tala um öryggisbil í spám. Öryggisbil eiga við óvissu í parameter-mati. Óvissa í spám er annars eðlis.

- Rakel Birta Hafliðadóttir: Gengi kr/usd og innflutingur frá USA (CIF). Hér er gott að hugleiða fræðin um PPP og UIP. Eðlilegt að athuga aðlögun vegna verðbreytinga með VECM. Það væri gott að skýra FEVD og J-kúrfu.
- Júlía Lis Svansdóttir: Tengsl hlutabréfa verðs Apple og Samsung. Áhuga verður samanburður á bandarísku fyrirtæki og kóreönsku. Athuga fylgni reikninga, eru þeir á hlutfallslegum verðbreytingum? Ef reiknuð er fylgni milli tímaraða þarf amk. önnur að vera eins og white-noise.
- Valgerður Helga Ísaksdóttir: Húsnæðisverð og barneignir. Húsnæðisnotkun/landnóktun hefur lengi verið viðfangsefni hagfræðinga. Húsnæðið þarf að henta fjölskyldum og hagstjórnaraðilum því vandi á höndum.
- Agnes Erla Blomsterberg: Gini-stuðull og atvinnuleysi. Hér er gott að hugleiða hvernig atvinnuleysi er mælt og skilgreint. Einnig er gott að fram komi atriði um eiginleika Gini-stuðulsins.
- Gylfi Geir Albertsson: Drifkraftar leiguverðs. Hér má fjalla um húsnæðis, hvernig að er notað og hvers konar fjárfestingarkostur það er. Innflutningur á fólki, ferðamenn og vinnuafli eru áhugaverðar stærðir. Vextir, regluverk og skipulagsmál eru einnig áhugaverðar stærðir.
- Björgvin Viðar Þórðarson: Hjónaskilnaðir og áfengisneysla. Hér virðist vera í gangi case-skoðun á áhrifum afnáms bjórbannsins. Hér (eins og alltaf) er gott að huga að einingum, lítrum af hvaða efni. Gott er að skoða hazard-fallið í kafla 5 í bókinni og hugleiða hættuna á að lenda í hjónabandi og hættuna á að verða aftur einhleypur. Efnahagseiningin hjónaband er mjög hagfelld. Hjón geta skipt með sér verkum þannig að tekjur (og gjöld) nýtist betur (economics of scale).