

SPIS TREŚCI

WSTĘP	9
1. MODEL EKONOMETRYCZNY	11
1.1. Przedmiot ekonometrii	11
1.2. Pojęcie modelu ekonometrycznego	12
1.3. Specyfikacja modelu	13
1.4. Etapy budowy modelu ekonometrycznego	17
1.5. Klasyfikacja modeli ekonometrycznych	21
1.6. Ogólna postać modelu ekonometrycznego	27
1.7. Jakościowe zmienne objaśniające	30
1.8. Wybór zmiennych objaśniających do liniowego modelu ekonometrycznego	32
1.9. Wybór postaci analitycznej modelu ekonometrycznego	39
Pytania sprawdzające	41
2. DANE STATYSTYCZNE W BADANIACH EKONOMETRYCZNYCH	43
2.1. Uwagi wstępne	43
2.2. Szeregi czasowe a dane przekrojowe	44
2.3. Agregacja danych	48
2.4. Zmienne syntetyczne	50
2.5. Uzupełnianie brakujących danych	51
2.6. Bazy danych	52
Pytania sprawdzające	53
3. METODA NAJMNIEJSZYCH KWADRATÓW	54
3.1. Istota metody najmniejszych kwadratów	54
3.2. Własności estymatorów	62
3.3. Macierz wariancji i kowariancji składnika losowego a założenia klasyczne dotyczące składnika losowego	64

3.4. Weryfikacja modelu	66
3.5. Badanie istotności parametrów strukturalnych modelu ekonometrycznego	67
3.6. Weryfikacja hipotezy o jednorodności wariancji składnika losowego	70
3.7. Badanie autokorelacji składnika losowego	74
Pytania sprawdzające	79
4. INNE METODY ESTYMACJI MODELI JEDNO- RÓWNANIOWYCH	80
4.1. Uogólniona metoda najmniejszych kwadratów	80
4.2. Metoda zmiennych instrumentalnych	88
4.3. Metoda najmniejszych kwadratów przy warunkach pobocznych	90
4.4. Uwagi o estymacji modeli nieliniowych	96
Pytania sprawdzające	99
5. MODELE WIELORÓWNANIOWE	101
5.1. Uwagi wstępne	101
5.2. Estymacja wielorównaniowych modeli prostych	102
5.3. Uwagi o estymacji modeli rekurencyjnych	104
5.4. Identyfikowalność modeli o równaniach współzależnych	107
5.5. Pośrednia metoda najmniejszych kwadratów	109
5.6. Podwójna metoda najmniejszych kwadratów	113
Pytania sprawdzające	119
6. WNIOSKOWANIE NA PODSTAWIE MODELU EKONOMETRYCZNEGO	121
6.1. Uwagi wstępne	121
6.2. Miary elastyczności	121
6.3. Analiza dynamicznych własności modelu	125
6.4. Postać końcowa modelu i analiza mnożnikowa	132
6.5. Elementy symulacji	134
Pytania sprawdzające	135

7. ELEMENTY PREDYKCJI EKONOMETRYCZNEJ	137
7.1. Uwagi wstępne	137
7.2. Zasady predykcji	139
7.3. Założenia teorii predykcji	140
7.4. Mierniki dokładności predykcji	141
7.5. Metody budowy prognoz	145
7.6. Predykcja na podstawie modeli tendencji rozwojowej	149
7.7. Predykcja na podstawie modeli adaptacyjnych	154
Pytania sprawdzające	156
Wartości krytyczne testu Durbina–Watsona	158
Wartości krytyczne testu t–Studenta	159
Wartości krytyczne testu F Snedecora	160
LITERATURA	161