

# Spis treści

<b>Wstęp</b> .....	7
<b>Rozdział 1. Model ekonometryczny. Budowa, estymacja i weryfikacja</b> .....	9
1.1. Postać modelu ekonometrycznego .....	9
1.2. Dobór zmiennych do modelu .....	10
1.3. Estymacja parametrów modelu KMNK .....	19
1.4. Weryfikacja modelu.....	19
1.5. Szacowanie parametrów strukturalnych modelu metodą najmniejszych kwadratów i jego weryfikacja w Excelu.....	25
1.6. Szacowanie parametrów strukturalnych modelu metodą najmniejszych kwadratów i jego weryfikacja w programie Gretl .....	39
Zadania.....	47
<b>Rozdział 2. Inne metody estymacji modeli jednorównaniowych</b> .....	59
2.1. Autokorelacja składnika losowego .....	60
2.2. Heteroskedastyczność składnika losowego.....	86
Zadania.....	91
<b>Rozdział 3. Modele wielorównaniowe</b> .....	95
3.1. Estymacja modeli wielorównaniowych.....	95
3.2. Wnioskowanie na podstawie modeli wielorównaniowych .....	111
3.3. Analiza dynamicznych własności modelu z wykorzystaniem analizy mnożnikowej .....	116
Zadania.....	122
<b>Rozdział 4. Prognozowanie ekonometryczne</b> .....	127
4.1. Predykcja nieobciążona .....	127
4.2. Modele szeregów czasowych z trendem .....	147
4.3. Predykcja na podstawie mierników elastyczności .....	177
Zadania.....	182
<b>Odpowiedzi</b> .....	191
<b>Literatura</b> .....	207