

Spis treści

Wprowadzenie	7
Rozdział 1. Modelowanie ekonometryczne	9
1.1. Istota modelu ekonometrycznego i jego elementy składowe	9
1.2. Etapy budowy modelu ekonometrycznego	11
1.3. Klasyfikacja modeli ekonometrycznych	15
Rozdział 2. Dobór zmiennych objaśniających do modelu ekonometrycznego .	17
2.1. Współczynnik zmienności jako kryterium doboru zmiennych	17
2.2. Metoda analizy współczynników korelacji jako podstawa doboru zmiennych	20
2.3. Wykorzystanie współczynników korelacji wielorakiej w celu doboru zmiennych	22
2.4. Dobór zmiennych objaśniających metodą Hellwiga	24
Zadania	27
Rozdział 3. Estymacja parametrów liniowego modelu ekonometrycznego . .	33
3.1. Pojęcie estymacji i estymatora. Założenia klasycznej metody najmniejszych kwadratów (KMNK)	33
3.2. Estymacja parametrów modelu z jedną zmienną objaśniającą	36
3.3. Estymacja parametrów modelu liniowego z wieloma zmiennymi objaśniającymi	41
Zadania	48
Rozdział 4. Weryfikacja jednorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	53
4.1. Istotność parametrów strukturalnych	53
4.2. Badanie normalności składnika losowego	58
4.3. Badanie autokorelacji składnika losowego	62
4.4. Badanie jednorodności wariancji składnika losowego	66
Zadania	67
Rozdział 5. Wykorzystanie jednorównaniowych modeli ekonometrycznych do prognozowania	71
5.1. Pojęcie, funkcje i klasyfikacja prognoz	71
5.2. Zasady i metody prognozowania	73
5.3. Budowa prognoz punktowych i przedziałowych	75
5.4. Mierniki dokładności predykcji	86
Zadania	99

Rozdział 6. Nieliniowe modele ekonometryczne	106
6.1. Typy modeli nieliniowych	106
6.2. Estymacja parametrów modeli nieliniowych	106
6.2.1. Modele liniowe względem parametrów	106
6.2.2. Modele linearyzowane przez logarytmowanie	113
Zadania	122
Odpowiedzi do zadań	124
Rozdział 2	124
Rozdział 3	124
Rozdział 4	125
Rozdział 5	126
Rozdział 6	126
Tablice	128
Bibliografia	139