

SPIS TREŚCI

Od autora	5
Wiadomości ogólne	7
1. Dobór zmiennych objaśniających do modelu liniowego	11
1.1 Uwagi wstępne	11
1.2. Eliminowanie zmiennych <i>quasi</i> -stałych	12
1.3. Wektor i macierz współczynników korelacji	14
1.4. Metoda analizy macierzy współczynników korelacji	19
1.5. Metoda wskaźników pojemności informacyjnej	23
1.6. Współczynnik korelacji wielorakiej	27
1.7. Efekt katalizy w modelu ekonometrycznym	31
2. Szacowanie parametrów modeli liniowych metodą najmniejszych kwadratów	36
2.1. Uwagi wstępne	36
2.2. Szacowanie parametrów modelu z jedną zmienną objaśniającą	37
2.3. Szacowanie parametrów modelu z wieloma zmiennymi objaśniającymi	45
3. Weryfikacja modeli liniowych	53
3.1. Uwagi wstępne	53
3.2. Ocena dopasowania modelu do danych empirycznych	53
3.3. Badanie istotności parametrów strukturalnych	59
3.4. Określenie relatywnego wpływu zmiennych objaśniających na zmienną objaśnianą	62
4. Modele nieliniowe sprowadzalne do liniowych	64
4.1. Uwagi wstępne	64
4.2. Wybór postaci analitycznej modelu na podstawie apriorycznej wiedzy o badanych zależnościach	64
4.3. Wybór postaci analitycznej modelu na podstawie wykresów rozrzutu punktów empirycznych	66
4.4. Dobór zmiennych objaśniających	72
4.5. Szacowanie parametrów	78
4.6. Badanie dopasowania modelu do danych empirycznych	85
5. Badanie własności odchyłeń losowych	89
5.1. Uwagi wstępne	89
5.2. Badanie losowości	89
5.3. Badanie normalności rozkładu	93
5.4. Badanie nieobciążoności	96
5.5. Badanie autokorelacji	99
5.6. Badanie stałości wariancji	103
6. Niektóre specjalne metody szacowania parametrów modeli liniowych	109
6.1. Uwagi wstępne	109
6.2. Uogólniona metoda najmniejszych kwadratów	109
6.3. Metoda różniczki zupełnej	119

6.4. Metoda zmiennych instrumentalnych	123
6.5. Metoda największej wiarygodności	128
7. Sekwencyjne procedury budowania modelu	133
7.1. Uwagi wstępne	133
7.2. Budowanie modelu z koincydencją	133
7.3. Procedura eliminacji <i>a posteriori</i>	139
7.4. Procedura selekcji krokowej	142
8. Modele wielorównaniowe	147
8.1. Uwagi wstępne	147
8.2. Postać strukturalna i postać zredukowana modelu	147
8.3. Klasyfikacja modeli wielorównaniowych	152
8.4. Szacowanie parametrów modeli prostych i rekurencyjnych	155
8.5. Identyfikowalność modeli o równaniach współzależnych	162
8.6. Pośrednia metoda najmniejszych kwadratów	166
8.7. Podwójna metoda najmniejszych kwadratów	173
9. Predykcja ekonometryczna	180
9.1. Uwagi wstępne	180
9.2. Predykcja na podstawie trendu	180
9.3. Predykcja na podstawie modelu opisowego	184
9.4. Predykcja metodą wag harmoniczych	190
Tablice statystyczne	196
Rozwiązania zadań	210
Literatura	220