

Spis treści

Od autorów	8
Rozdział 1. Wprowadzenie	11
1.1. Wiadomości ogólne o ekonometrii	11
1.2. Dane statystyczne	12
Rozdział 2. Model ekonometryczny	15
Rozdział 3. Jednorównaniowy liniowy model ekonometryczny z jedną zmienną objaśniającą	17
3.1. Postać jednorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego z jedną zmienną objaśniającą	17
3.2. Estymacja parametrów modelu z jedną zmienną objaśniającą metodą najmniejszych kwadratów	18
3.3. Zadania	23
Rozdział 4. Klasyczna metoda najmniejszych kwadratów	25
4.1. Założenia klasycznej metody najmniejszych kwadratów	26
4.2. Estymacja parametrów modelu z wieloma zmiennymi objaśniającymi metodą najmniejszych kwadratów	27
4.3. Własności estymatorów uzyskanych metodą najmniejszych kwadratów	32
4.4. Model ekonometryczny a model regresji	34
4.5. Współczynniki regresji netto a współczynniki regresji brutto	35
4.6. Dopasowanie modelu do danych empirycznych	37
4.6.1. Odchylenie standardowe reszt	37
4.6.2. Analiza wariancji zmiennej objaśnianej	38
4.6.3. Współczynniki determinacji	42
4.6.4. Inne miary dopasowania modelu do danych	44
4.7. Wnioskowanie o parametrach liniowego modelu ekonometrycznego	47
4.7.1. Dalsze konsekwencje przyjęcia założeń klasycznej metody najmniejszych kwadratów	47
4.7.2. Przedziały ufności dla parametrów strukturalnych	49
4.7.3. Testowanie hipotez dotyczących wartości parametrów strukturalnych	51
4.7.4. Przyczyny braku statystycznej istotności parametrów	57
4.8. Dobór zmiennych objaśniających do modelu	59
4.8.1. Eliminowanie zmiennych quasi-stałych	62
4.8.2. Metoda Hellwiga	63
4.8.3. Sekwencyjne metody doboru zmiennych objaśniających do modelu	66
4.9. Zadania	72
Rozdział 5. Weryfikacja modelu	76
5.1. Wiadomości ogólne	76

5.2. Badanie własności odchyżeń losowych	77
5.2.1. Wprowadzenie	77
5.2.2. Badanie losowości	77
5.2.3. Badanie normalności	82
5.2.4. Badanie autokorelacji	86
5.2.5. Badanie homoskedastyczności	93
5.3. Zadania	99
Rozdział 6. Zmienne jakościowe	102
6.1. Zadania	113
Rozdział 7. Metody szacowania parametrów modeli ekonometrycznych w przypadku wystąpienia autokorelacji i heteroskedastyczności	113
7.1. Uogólniona metoda najmniejszych kwadratów	114
7.2. Metoda różniczki zupełnej	118
7.3. Metoda Cochrane'a-Orcutta	120
7.4. Ważona metoda najmniejszych kwadratów	122
7.5. Zadania	126
Rozdział 8. Inne metody estymacji parametrów jednorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	131
8.1. Estymacja parametrów metodą największej wiarygodności	131
8.2. Zadania	134
Rozdział 9. Nieliniowe modele ekonometryczne	136
9.1. Nieliniowe typy funkcji w badaniach ekonomiczno-rolniczych	137
9.2. Metody doboru postaci analitycznej modelu	142
9.3. Metody estymacji modeli nieliniowych	147
9.3.1. Estymacja parametrów modeli nieliniowych poprzez ich linearyzację	148
9.3.2. Metody numeryczne estymacji modeli nieliniowych	151
9.4. Zadania	154
Rozdział 10. Funkcja produkcji	158
10.1. Badania elastyczności produkcji	162
10.2. Rachunek marginalny	167
10.3. Substytucja czynników produkcji	169
10.4. Dynamiczne funkcje produkcji	171
10.5. Funkcja produkcji typu CES	174
10.6. Zadania	180
Rozdział 11. Ekonometryczna analiza rynku	186
11.1. Badania rozkładu dochodów za pomocą krzywej Pareta	186
11.2. Badania rozkładu dochodów za pomocą krzywej normalnej	193
11.3. Badania rozkładu dochodów za pomocą krzywej logarytmiczno-normalnej	196
11.4. Zadania	200
Rozdział 12. Ekonometryczna analiza popytu konsumpcyjnego	202
12.1. Badania dochodowej elastyczności popytu	203
12.2. Analiza logitowa	212
12.3. Zadania	215
Rozdział 13. Modele wielorównaniowe	221
13.1. Wiadomości wstępne	221
13.2. Klasyfikacja zmiennych	222
13.3. Postać strukturalna i zredukowana modelu	223
13.4. Klasyfikacja modeli wielorównaniowych	227
13.5. Problem identyfikacji	229
13.6. Estymacja parametrów modeli wielorównaniowych	234

13.6.1. Estymacja parametrów modeli prostych i rekurencyjnych	235
13.6.2. Estymacja parametrów modeli o równaniach współzależnych	236
13.7. Weryfikacja modelu wielorównaniowego	243
13.8. Zadania	243
Rozdział 14. Wykorzystanie jednorównaniowych modeli ekonometrycznych do pro-	
gnozowania	245
14.1. Założenia predykcji	245
14.2. Prognoza punktowa i przedziałowa	246
14.3. Zadania	254
Odpowiedzi do zadań	259
Aneks 1. Dane statystyczne	277
Aneks 2. Tablice statystyczne	279
Bibliografia	289