

Spis treści

1. Regresja jako warunkowa wartość oczekiwana	5
1.1. Regresja I i II rodzaju	5
1.2. Regresja jednej zmiennej (metoda najmniejszych kwadratów)	12
2. Dobór zmiennych objaśniających do liniowego modelu ekonometrycznego i badanie współzależności zmiennych	20
2.1. Współczynnik korelacji liniowej Pearsona, badanie jego istotności – test istotności. Macierz korelacji	21
2.2. Współczynnik korelacji wielorakiej	31
2.3. Dobór zmiennych objaśniających do modelu metodą analizy współczynników korelacji	36
2.4. Dobór zmiennych objaśniających do modelu metodą wskaźników pojemności informacji	41
2.5. Dobór zmiennych objaśniających do modelu metodą grafową	49
3. Standardowy model liniowy i klasyczna metoda najmniejszych kwadratów	54
3.1. Założenia standardowego modelu liniowego	54
3.2. Estymacja parametrów modelu liniowego klasyczną metodą najmniejszych kwadratów	55
3.3. Metoda najmniejszych kwadratów przy warunkach pobocznych	70
4. Transformacja liniowa	77
5. Metody analizy szeregów dynamicznych	92
5.1. Uwagi wstępne	92
5.2. Funkcje trendu	93
5.3. Adaptacyjne metody wyodrębniania tendencji rozwojowej	100
5.4. Analiza wahań sezonowych	107
5.5. Modele dynamiczne ze zmiennymi opóźnionymi w czasie	114
6. Weryfikacja modelu	120
6.1. Dopasowanie modelu do danych empirycznych	120
6.2. Istotność parametrów strukturalnych	121
6.3. Badanie autokorelacji składnika losowego	126
6.4. Heteroscedastyczność	130
6.5. Normalność rozkładu składnika losowego	134
6.6. Badanie losowości	138
6.7. Obserwacje nietypowe i wpływowe	141

7. Szacowanie parametrów modelu liniowego uogólnioną metodą najmniejszych kwadratów	152
7.1. Uwagi wstępne	152
7.2. Uogólniona metoda najmniejszych kwadratów	152
7.3. Heteroscedastyczność składników losowych. Ważona metoda najmniejszych kwadratów	154
7.4. Autokorelacja składników losowych. Proces AR(1)	156
8. Modele wielorównaniowe i podwójna metoda najmniejszych kwadratów ...	163
8.1. Klasyfikacja zmiennych i modeli	163
8.2. Estymacja modeli prostych i rekurencyjnych	167
8.3. Identyfikowalność modeli	172
8.4. Podwójna metoda najmniejszych kwadratów	174
8.5. Uwagi o własnościach estymatora	179
9. Zastosowania metod ekonometrycznych	186
9.1. Analiza produkcji	186
9.2. Analiza popytu	203
9.3. Analiza kosztów	213
10. Wybrane problemy wielowymiarowej analizy porównawczej	225
10.1. Uwagi wstępne	225
10.2. Analiza dyskryminacyjna	238
10.3. Metody klasyfikacji	244
10.4. Metody porządkowania liniowego	258
Aneks	275
Tablice statystyczne	283
Literatura	293