

Spis treści

Od autora

Wiadomości ogólne

1. Dobór zmiennych objaśniających do modelu liniowego

Uwagi wstępne

Eliminowanie zmiennych quasi-stałych

Wektor i macierz współczynników korelacji

Metoda analizy macierzy współczynników korelacji

Metoda wskaźników pojemności informacyjnej

Współczynnik korelacji wielorakiej

Efekt katalizy w modelu ekonometrycznym

2. Szacowanie parametrów modeli liniowych metodą najmniejszych kwadratów

Uwagi wstępne

Szacowanie parametrów modelu z jedną zmienną objaśniającą

Szacowanie parametrów modelu z wieloma zmiennymi objaśniającymi

3. Weryfikacja modeli liniowych

Uwagi wstępne

Ocena dopasowania modelu do danych empirycznych

Badanie istotności parametrów strukturalnych

Określenie relatywnego wpływu zmiennych objaśniających na zmienną objaśnianą

4. Modele nieliniowe sprowadzalne do liniowych

Uwagi wstępne

Wybór postaci analitycznej modelu na podstawie apriorycznej wiedzy o badanych zależnościach

Wybór postaci analitycznej modelu na podstawie wykresów rozrzutu punktów empirycznych

Dobór zmiennych objaśniających

Szacowanie parametrów

Badanie dopasowania modelu do danych empirycznych

5. Badanie własności odchyłeń losowych

Uwagi wstępne

Badanie losowości

Badanie normalności rozkładu

Badanie nieobciążoności

Badanie autokorelacji

Badanie stałości wariancji

6. Niektóre specjalne metody szacowania parametrów modeli liniowych

Uwagi wstępne

Uogólniona metoda najmniejszych kwadratów

Metoda różniczki zupełnej

Metoda zmiennych instrumentalnych

Metoda największej wiarygodności

7. Sekwencyjne procedury budowania modelu

Uwagi wstępne

Budowanie modelu z koincydencją

Procedura eliminacji a posteriori

Procedura selekcji krokowej

8. Modele wielorównaniowe

Uwagi wstępne

Postać strukturalna i postać zredukowana modelu

Klasyfikacja modeli wielorównaniowych

Szacowanie parametrów modeli prostych i rekurencyjnych

Identyfikowalność modeli o równaniach współzależnych

Pośrednia metoda najmniejszych kwadratów

Podwójna metoda najmniejszych kwadratów

9. Predykcja ekonometryczna

Uwagi wstępne

Predykcja na podstawie trendu

Predykcja na podstawie modelu opisowego

Predykcja metodą wag harmoniczných

Tablice statystyczne

Rozwiązania zadań

Literatura