

Niniejszy podręcznik zawiera podstawowy kurs ekonometrii i jest przeznaczony dla studentów różnych dyscyplin ekonomicznych. Prezentowane zagadnienia są podawane od podstaw i nie są nadmiernie skomplikowane pod względem formalnym. Autorowi udało się w sposób syntetyczny, bez odsyłania do zaawansowanej matematyki lub statystyki, za to ze wskazaniem możliwości aplikacyjnych, omówić zagadnienia zwykle uważane za trudne.

Książka będzie również przydatna tym wszystkim, którzy prowadzą analizy ekonomiczne, a nie dysponują szeroką wiedzą matematyczno-statystyczną.

W podręczniku w sposób uporządkowany przedstawiono kolejne etapy budowy modelu ekonometrycznego, dobór zmiennych do modelu oraz podstawowe metody szacowania jego parametrów, wraz z oceną trafności tego oszacowania, oraz podano pod dyskusję problem wykorzystania tego modelu do celów prognostycznych. Odrębną część stanowi omówienie modeli nieklasycznych. Warto podkreślić, że w każdym z rozdziałów zawarto dobrze dobrane i szczegółowo przeanalizowane przykłady ilustrujące prezentowane w rozdziale zagadnienie odpowiednio o charakterze teoretycznym lub praktycznym (...). Każdy z rozdziałów, oprócz pierwszego, zakończony jest sporą liczbą przykładów do samodzielnego rozwiązania (...). Kontrolę stopnia opanowania materiału ułatwiają rozwiązania wszystkich zadań zamieszczone w odrębnym rozdziale na końcu podręcznika.

Dr hab. Maria Balcerowicz-Szcutnik, prof. UE
Katedra Metod Statystyczno-Matematycznych w Ekonomii
Uniwersytet Ekonomiczny w Katowicach

Dr Mieczysław Sobczyk jest doświadczonym dydaktykiem, związanym z Zakładem Statystyki i Ekonometrii Uniwersytetu Marii Curie-Skłodowskiej w Lublinie.

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