

Ekonometria. Zbiór zadań Aleksander Welfe, Wojciech Grabowski

Zbiór zadań stanowi uzupełnienie podręcznika pt. Ekonometria. Metody i ich zastosowanie autorstwa Aleksandra Welfe, choć może być wykorzystywany samodzielnie jako pomoc dydaktyczna do zajęć z ekonometrii. Każdy rozdział poprzedzają rozwiązane zadania, a kończą odpowiedzi i wskazówki do zadań. Zadania można rozwiązywać za pomocą kalkulatora lub komputera, wykorzystując programy pozwalające wykonać działania na wektorach i macierzach. Akcent położono głównie na zastosowanie metod ekonometrycznych.

Spis treści

Wstęp

1. Klasyczny model regresji liniowej - przypadek jednej zmiennej objaśniającej
2. Klasyczny model regresji liniowej - przypadek wielu zmiennych objaśniających
3. Metoda największej wiarygodności
4. Autokorelacja
5. Heteroskedastyczność
6. Współliniowość
7. Modele specjalne
8. Prognozy na podstawie modeli jednorównaniowych
9. Modele wielorównaniowe o równaniach współzależnych
10. Symulacje i wykorzystanie modeli wielorównaniowych
11. Modelowanie na podstawie szeregów niestacjonarnych