

## Opis

Metody ekonometryczne znajdują coraz szersze zastosowanie w różnych dziedzinach badań ekonomicznych. Nie można jednak stwierdzić, że możliwości ekonometrii zostały już dobrze poznane. Na rynku wydawniczym ceni się szczególnie prace, w których najbardziej skomplikowane metody ekonometryczne są przedstawione w taki sposób, aby stały się zrozumiałym narzędziem badawczym. Do takich książek należy niniejszy podręcznik, od wielu lat cieszący się uznaniem studentów i wykładowców,

## Spis treści

Od autora

Wiadomości ogólne

### **1. Dobór zmiennych objaśniających do modelu liniowego**

1.1 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 harmonicznnych

Tablice statystyczne

Rozwiązania zadań

Literatura

