

[opis]

W literaturze z obszaru prognozowania ekonometrycznego dominują rozwiązania dotyczące modeli o jednym równaniu stochastycznym. Prace prognostyczne obejmujące wykorzystanie modeli wielorównaniowych koncentrowały się na makromodelach ekonometrycznych. Niniejsza monografia jest pierwszym obszernym studium prognostycznym, skoncentrowanym na modelach opisujących głównie mechanizmy przedsiębiorstwa. Specyfiką książki jest wykorzystanie danych statystycznych z rzeczywiście istniejących przedsiębiorstw. Zwracają uwagę nowatorskie rozwiązania, zwłaszcza wykorzystanie opracowanej przez autora, iteracyjnej metody prognozowania z układów równań współzależnych.

[spis]

Wstęp / 7

## ROZDZIAŁ PIERWSZY

Jednorównaniowy model ekonometryczny / 9

1.1. Istota modelu ekonometrycznego / 9

1.2. Specyfikacja modelu ekonometrycznego / 13

1.3. Estymacja parametrów modelu ekonometrycznego / 14

1.4. Weryfikacja modelu / 21

1.5. Ekonometryczne modele iloczynowe / 26

1.6. Ograniczone zmienne endogeniczne / 29

## ROZDZIAŁ DRUGI

Wielorównaniowe modele ekonometryczne / 37

2.1. Klasyfikacja modeli wielorównaniowych / 37

2.2. Forma zredukowana modelu / 42

2.3. Identyfikacja modelu / 44

2.4. Estymacja parametrów wielorównaniowego modelu ekonometrycznego / 47

## ROZDZIAŁ TRZECI

Prognozy ekonometryczne / 55

3.1. Pojęcie prognozy ekonometrycznej / 55

3.2. Warunki szacowania prognoz ekonometrycznych / 58

3.3. Prognozy na podstawie modeli jednorównaniowych / 60

3.4. Analiza trafności prognoz ekonometrycznych / 63

3.5. Szacowanie prognoz na podstawie modeli wielorównaniowych / 65

## ROZDZIAŁ CZWARTY

Prognozowanie z prostych mikromodeli ekonometrycznych / 75

4.1. Prognozy z mikromodelu kosztów przedsiębiorstwa / 75

4.2. Prognozowanie skuteczności robotnika na podstawie układu dwóch równań prostych / 84

4.3. Prognozowanie skuteczności handlowca na podstawie układu dwóch równań prostych / 94

## ROZDZIAŁ PIĄTY

Prognozowanie z rekurencyjnych mikromodeli ekonometrycznych / 105

- 5.1. Prognozy z ekonometrycznego modelu średniego przedsiębiorstwa / 105
- 5.2. Ekonometryczne prognozy kosztów przedsiębiorstwa sprzedającego sprzęt sportowy / 122
- 5.3. Prognozy z rekurencyjnego modelu rynku kart płatniczych w Chinach / 131

## ROZDZIAŁ SZÓSTY

Prognozowanie z ekonometrycznego mikromodelu w postaci układu równań współzależnych / 153

- 6.1. Specyfika prognozowania przedsiębiorstwa jako systemu ekonomicznego / 153
- 6.2. Iteracyjna metoda prognozowania z mikromodelu ekonometrycznego o zamkniętym cyklu powiązań przy założeniu inercji systemu / 165
- 6.3. Prognozy uzyskane iteracyjnie przy ingerencji w system za pomocą zmiennych sterujących / 178
- 6.4. Prognozowanie płynności finansowej i efektywności windykacji wierzytelności z wykorzystaniem prognoz zmiennych tworzących cykl / 186

Podsumowanie / 197

Spis literatury / 199