

SPIS RZECZY

Przedmowa do wydania drugiego	9
Słowo wstępne	11
1. Konstrukcja liniowych modeli jednorównaniowych (Karol Kukuła)	15
1.1. Uwagi wstępne o modelowaniu ekonometrycznym	15
1.2. Wybór zmiennych objaśniających metodami statystycznymi	16
1.2.1. Badanie pojemności nośników informacji metodą Hellwiga	16
1.2.2. Metoda analizy grafów	23
1.3. Wybór postaci analitycznej modelu	25
1.4. Estymacja modelu klasyczną metodą najmniejszych kwadratów (KMNK)	36
1.5. Weryfikacja	50
1.5.1. Testowanie parametrów strukturalnych modelu	51
1.5.2. Analiza wybranych własności rozkładu reszt	55
1.6. Merytoryczna interpretacja parametrów strukturalnych oszacowanych modeli	63
Zadania	66
2. Modele nieliniowe (Antoni Goryl)	90
2.1. Nieliniowa metoda najmniejszych kwadratów — algorytm Gaussa–Newtona	91
2.2. Wybrane przykłady	96
2.2.1. Funkcje Törnquista	96
2.2.2. Krzywe sigmoidalne — trend logistyczny	102
Zadania	106
3. Predykcja na podstawie modeli jednorównaniowych (Zbigniew Jędrzejczyk)	112
3.1. Klasyczna predykcja na podstawie modeli przyczynowo-opisowych	113
3.2. Modele tendencji rozwojowej jako narzędzie predykcji	118
3.3. Wybrane modele adaptacyjne w procesie predykcji	126
3.3.1. Model wyrównywania wykładniczego	126
3.3.2. Metoda wag harmonicznych	131
3.4. Predykcja na podstawie modeli trendów jednoimiennych okresów	135
Zadania	139
4. Analiza procesu produkcyjnego (Antoni Goryl)	154
4.1. Modele produkcji	154
4.1.1. Funkcja produkcji typu Cobba–Douglasa	154
4.1.2. Funkcja produkcji typu CES	163
4.1.3. Badanie efektów postępu organizacyjno-technicznego	171

4.2. Funkcja wydajności pracy	173
4.3. Funkcja kosztów	180
Zadania	184
5. Elementy ekonometrycznej analizy rynku (Anna Walkosz)	196
5.1. Wybrane rozkłady dochodów	196
5.2. Ekonometryczna analiza popytu konsumpcyjnego	219
5.2.1. Makroekonomiczne funkcje popytu	220
5.2.2. Mikroekonomiczne funkcje popytu	229
5.3. Zróżnicowanie struktur wydatków gospodarstw domowych	244
Zadania	251
6. Liniowe modele wielorównaniowe (Jacek Osiewalski)	277
6.1. Przykłady ekonomiczne	277
6.1.1. Teoria konsumenta — systemy wydatków	277
6.1.2. Teoria firmy — równania popytu na czynniki produkcji	279
6.1.3. Modele rynku w równowadze	281
6.1.4. Modele gospodarki	284
6.2. Postacie i klasy modeli	285
6.2.1. Postać strukturalna i zredukowana	285
6.2.2. Macierz równoczesnych kowariancji	291
6.2.3. Modele proste, rekurencyjne i współzależne	293
6.3. Wprowadzenie do estymacji	295
6.3.1. Stosowalność zwykłej MNK	295
6.3.2. Identyfikowalność modelu współzależnego	299
6.3.3. Pośrednia MNK	303
6.3.4. Dwustopniowa (podwójna) MNK	304
6.4. Wykorzystanie modeli wielorównaniowych	308
6.4.1. Prognozowanie	309
6.4.2. Postać końcowa i analiza mnożnikowa	312
Zadania	317
Odpowiedzi do zadań	322
Uwagi bibliograficzne	364
Literatura	368