

SPIS TREŚCI

Wstęp ... 5

1. Pojęcia podstawowe ... 7

- 1.1. Przedmiot ekonometrii, model ekonomiczny i ekonometryczny ... 7
- 1.2. Klasyfikacja modeli ekonometrycznych ... 9
- 1.3. Etapy modelowania ekonometrycznego ... 12
- 1.4. Rodzaje danych i zmiennych ... 14
- 1.5. Dobór zmiennych do modelu ekonometrycznego ... 16

2. Regresja prosta ... 24

- 2.1. Ogólne założenia ... 24
- 2.2. Metoda momentów ... 26
- 2.3. Metoda najmniejszych kwadratów ... 27
- 2.4. Hipoteza o poprawności modelu ekonometrycznego ... 41

3. Regresja wieloraka ... 43

- 3.1. Wiadomości wprowadzające ... 43
- 3.2. Metoda najmniejszych kwadratów ... 43
- 3.3. Hipoteza o poprawności modelu ekonometrycznego ... 57

4. Regresja nieliniowa ... 58

- 4.1. Cechy charakterystyczne i podział ... 58
- 4.2. Nieliniowe modele regresyjne sprowadzalne do postaci liniowej ... 62
- 4.3. Ścisłe nieliniowe modele regresyjne ... 83

5. Prognozowanie na podstawie modelu ekonometrycznego ... 88

- 5.1. Prognozy i prognozowanie ... 88
- 5.2. Badanie stabilności modelu ekonometrycznego testem Chowa ... 90
- 5.3. Prognoza punktowa i błędy prognozy ... 93

6. Wstęp do teorii optymalizacji ... 99

- 6.1. Podejmowanie decyzji i modele decyzyjne ... 99
- 6.2. Matematyczny model procesu decyzyjnego – model optymalizacyjny ... 100
- 6.3. Klasyfikacja zadań optymalizacji ... 101
- 6.4. Analityczne rozwiązanie zadań optymalizacyjnych ... 103

7. Optymalizacja liniowa ... 110

- 7.1. Zadanie optymalizacji liniowej ... 110
- 7.2. Metoda graficzna ... 112
- 7.3. Metoda sympleksów ... 113
- 7.4. Analiza wrażliwości ... 129
- 7.5. Dualizm w optymalizacji liniowej ... 131
- 7.6. Przykłady typowych zadań optymalizacyjnych ... 133

8. Elementy programu Excel ... 140

8.1. Funkcje ... 140

8.2. Narzędzia ... 151

Literatura ... 158