

Spis treści

Wstęp	9
Rozdział 1. Wprowadzenie do zastosowań metod ekonometrycznych w naukach ekonomicznych	15
1.1. Geneza, cel i istota badań ekonometrycznych	15
1.2. Pojęcie i klasyfikacja modeli ekonometrycznych	21
1.3. Etapy budowy modelu ekonometrycznego	27
1.4. Zadania	30
Rozdział 2. Dobór zmiennych, zbieranie danych statystycznych, wybór postaci analitycznej poszczególnych równań	32
2.1. Wstępny dobór zmiennych	32
2.2. Zbieranie danych statystycznych i korekty zbioru zmiennych objaśniających	34
2.3. Wybór postaci analitycznej poszczególnych równań	42
2.4. Zadania	45
Rozdział 3. Estymacja i weryfikacja jednorównaniowego modelu ekonometrycznego	47
3.1. Estymacja jednorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	47
3.2. Uwagi o estymacji jednorównaniowych nieliniowych modeli ekonometrycznych	50
3.3. Weryfikacja jednorównaniowego modelu ekonometrycznego i jego przeformułowywanie	52
3.4. Zadania	60
Rozdział 4. Wykorzystanie jednorównaniowego modelu ekonometrycznego do analizy zjawisk w okresie diagnozy	62
4.1. Uwagi ogólne	62
4.2. Badanie zależności między ilością zakupowanego dobra a cenami, dochodami i upływem czasu	63
4.3. Analiza podaży	67
4.4. Zadania	71
Rozdział 5. Analiza mnożnikowa na podstawie postaci zredukowanej wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	75
5.1. Postać strukturalna wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	75
5.2. Uwagi o estymacji i weryfikacji wielorównaniowych modeli prostych i rekurencyjnych	76
5.3. Postać zredukowana wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego o równaniach współzależnych	78
5.4. Identyfikacja i estymacja wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego o równaniach współzależnych	79
5.5. Weryfikacja wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	80

5.6. Istota analizy mnożnikowej na podstawie postaci zredukowanej wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	81
5.7. Zadania	82
Rozdział 6. Analiza mnożnikowa na podstawie postaci końcowej wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	87
6.1. Pojęcie postaci końcowej wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	87
6.2. Istota analizy mnożnikowej na podstawie postaci końcowej wielorównaniowego liniowego modelu ekonometrycznego	90
6.3. Zadania	94
Rozdział 7. Uwagi wstępne o prognozowaniu	96
7.1. Pojęcie niepewności i ryzyka	96
7.2. Źródła niepewności i sposoby jej ograniczania	101
7.3. Prognozowanie i planowanie jako sposoby ograniczania niepewności i stwarzania ryzyka	102
7.4. Ogólna typologia metod prognozowania i ich istota	103
7.5. Ocena błędu prognozy	110
Rozdział 8. Prognozowanie metodami statystycznymi	112
8.1. Prognozowanie na podstawie miar statystycznych poziomu zmiennej (poziomu zjawiska)	113
8.2. Prognozowanie metodą interpolacji	115
8.3. Prognozowanie na podstawie miar statystycznych dynamiki zmiennej	116
8.4. Prognozowanie na podstawie współzależności zjawisk	121
8.5. Zadania	122
Rozdział 9. Prognozowanie przy wykorzystaniu liniowego modelu ekonometrycznego	123
9.1. Istota prognozowania ekonometrycznego na podstawie liniowego modelu jednorównaniowego	123
9.2. Istota prognozowania ekonometrycznego na podstawie liniowych modeli wielorównaniowych	127
9.2.1. Uwagi ogólne	127
9.2.2. Istota prognozowania ekonometrycznego na podstawie wielorównaniowych modeli prostych i rekurencyjnych	128
9.2.3. Prognozowanie na podstawie modeli wielorównaniowych o równaniach współzależnych	129
9.3. Zalety i wady prognozowania metodami ekonometrycznymi	131
9.4. Zadania	132
Rozdział 10. Analiza symulacyjna na podstawie nieliniowego wielorównaniowego modelu ekonometrycznego	133
10.1. Obliczanie wartości ocen parametrów strukturalnych i wartości teoretycznych nieliniowego wielorównaniowego modelu ekonometrycznego (rozwiązanie modelu)	133
10.2. Istota analizy symulacyjnej na podstawie nieliniowego wielorównaniowego modelu ekonometrycznego	136
10.3. Zadania	139
Rozdział 11. Sterowanie optymalne na podstawie modelu ekonometrycznego	141
11.1. Istota sterowania optymalnego na podstawie modelu ekonometrycznego	141
11.2. Ustalanie wartości współczynników funkcji wyboru	148
11.3. Rozwiązanie zadań sterowania optymalnego	150
11.3.1. Uwagi wstępne	150

11.3.2. Rozwiązywanie zadań z czasem dyskretnym i z liniowym modelem ekonometrycznym	152
11.3.3. Rozwiązywanie zadań z czasem dyskretnym i z nieliniowym modelem ekonometrycznym	154
11.4. Zadania	155
Rozdział 12. Prognozowanie metodami ekspertologicznymi	157
12.1. Istota i podział metod ekspertologicznych	157
12.2. Procedury prognozowania metodami ekspertologicznymi	159
12.3. Systematyzacja informacji otrzymanej od ekspertów	166
12.4. Zalety i wady metod ekspertologicznych	169
Rozdział 13. Wykorzystanie prognoz, analiz symulacyjnych i sterowania optymalnego w praktyce	171
13.1. Uwagi na temat zakresu zastosowań	171
13.2. Wybór metody badania	174
13.2.1. Charakterystyka przedmiotu badania	174
13.2.2. Charakterystyka metod badania	176
13.2.3. Logika wyboru	177
13.3. Uwagi końcowe	179
13.4. Zadania	180
Załącznik 1. Nagrody Nobla w dziedzinie nauk ekonomicznych	182
Załącznik 2. Algorytm budowy liniowego jednorównaniowego modelu ekonometrycznego przy wykorzystaniu arkusza kalkulacyjnego <i>Excel</i>	184
Załącznik 3. Rozkład serii reszt	193
Załącznik 4. Wartości krytyczne statystyk d_L i d_U	194
Literatura	195
Indeks	200