

## **SPIS TREŚCI**

<b>PROLOG</b> .....	9
<b>EPIZOD I</b>	
<b>MROczne WIDMO EKONOMETRII</b> .....	13
1.1. Czym jest ekonometria? .....	15
1.2. Co to jest model ekonometryczny? .....	18
1.2.1. Elementy modelu ekonometrycznego.....	21
1.2.2. Typologia modeli ekonometrycznych.....	24
1.3. Etapy modelowania ekonometrycznego .....	29
1.4. Obszary zastosowań modeli ekonometrycznych .....	31
<b>EPIZOD II</b>	
<b>EKONOMETRYCZNA ODYSEJA – WEJŚCIE NA ORBITĘ</b> .....	35
2.1. Aspekty teoretyczne specyfikacji zmiennych.....	37
2.2. Wstępna analiza danych do modelu .....	42
2.3. Metoda optymalnego doboru predyktant Z. Hellwiga .....	52
2.4. Prosta metoda grafowa S. Bartosiewicz .....	58
2.5. Metoda pozornej ortogonalizacji D. Strahl.....	64
<b>EPIZOD III</b>	
<b>TRAJEKTORIA LOTU</b> .....	73
3.1. Konstrukcja modelu. Metody doboru postaci analitycznej modelu .....	75
3.2. Transformacja liniowa .....	93

<b>EPIZOD IV</b>	
<b>WOJNA ŚWIATÓW – STARCIE PIERWSZE .....</b>	<b>101</b>
<b>EPIZOD V</b>	
<b>STACJA KOSMICZNA – ESTYMACJA .....</b>	<b>105</b>
5.1. Klasyczna metoda najmniejszych kwadratów. Estymacja modeli liniowych z wieloma zmiennymi objaśniającymi .....	107
5.2. Estymacja modeli liniowych z jedną zmienną objaśniającą .....	120
5.3. Estymacja modeli nieliniowych .....	129
5.4. Estymacja modeli dynamicznych. Estymacja modeli prostych i rekurencyjnych .....	137
5.5. Podwójna metoda najmniejszych kwadratów. Estymacja modeli o równaniach współzależnych .....	146
<b>EPIZOD VI</b>	
<b>WOJNA ŚWIATÓW – STARCIE DRUGIE .....</b>	<b>165</b>
<b>EPIZOD VII</b>	
<b>KONTROLA LOTU .....</b>	<b>169</b>
7.1. Weryfikacja modeli ekonometrycznych – badanie koincydencji i dopuszczalności modelu oraz normalności rozkładu elementu losowego .....	171
7.2. Weryfikacja modeli ekonometrycznych – badanie symetrii i losowości rozkładu elementu losowego oraz istotności parametrów strukturalnych modelu .....	185
7.3. Weryfikacja modeli ekonometrycznych – badanie nieobciążoności, stacjonarności i autokorelacji elementu losowego .....	201
<b>EPIZOD VIII</b>	
<b>DROGA DO GWIAZD .....</b>	<b>221</b>
8.1. Równowaga długookresowa. Regresja pozorna.....	223
8.2. Szeregi niestacjonarne i analiza stopnia integracji .....	228
8.3. Testowanie kointegracji.....	244
8.4. Modele korekty błędem (ECM) dla skointegrowanych szeregów czasowych .....	250

<b>EPIZOD IX</b>	
<b>WOJNA ŚWIATÓW – STARCIE TRZECIE .....</b>	<b>255</b>
<b>EPIZOD X</b>	
<b>SAMODZIELNY LOT – PO PROSTU ODLOT .....</b>	<b>259</b>
10.1. Internetowe bazy danych jako źródło informacji statystycznych <i>on-line</i> .....	261
10.2. Modelowanie zjawisk ekonomicznych – <i>case study</i> .....	268
10.3. Modelowanie relacji długookresowych z wykorzystaniem ECM - <i>case study</i> .....	270
<b>EPILOG .....</b>	<b>273</b>
<b>ANEKS</b>	
<b>BAZA NUMERUS – TABLICE STATYSTYCZNE.....</b>	<b>281</b>