

O B S A H

1	PODSTATY A CÍLE EKONOMETRIE	5
1.1	Vymezení předmětu zkoumání	5
1.2	Principy a cíle ekonometrického modelování	6
1.2.1	Formulace modelu	6
1.2.2	Kvantifikace modelu	8
1.2.3	Ekonomická, statistická a ekonometrická verifikace modelu	9
1.2.4	Způsoby využití modelu	10
	Literatura	12
2	TEORIE ODHADU V EKONOMETRII	13
2.1	Odhadové funkce a jejich vlastnosti	13
2.2	Metody bodového odhadu	16
2.3	Intervalový odhad	18
	Literatura	18
	Cvičení	19
3	STANDARDNÍ LINEÁRNÍ MODEL	21
3.1	<u>Metoda nejmenších čtverců</u>	22
3.1.1	Odhad regresních koeficientů	22
3.1.2	Odhad rozptylu náhodné složky	24
3.2	Statistická verifikace lineárního modelu	26
3.2.1	Významnost odhadnutých parametrů a intervaly spolehlivosti	26
3.2.2	Testování významnosti modelu jako celku	27
3.3	Předpověď	29
3.3.1	Ověření vhodnosti modelu k prognózování	30
3.3.2	Chyba předpovědi	34
	Literatura	38
	Cvičení	39
4	ZOBEZNĚNÍ LINEÁRNÍ MODEL	41
4.1	<u>Metoda zobecněných nejmenších čtverců</u>	41
4.2	Heteroskedasticita	43
4.2.1	Testování heteroskedasticity	47
4.3	Autokorelace	50
4.3.1	Testování sériové korelace	54
4.3.2	Autokorelace a předpověď	60
4.4	Soustavy lineárních regresních rovnic	61
	Literatura	64
	Cvičení	66
5	EKONOMETRICKÉ PROBLÉMY LINEÁRNÍHO MODELU	69
5.1	Multikolinearita	69
5.1.1	Zjišťování stupně multikolinearity	71
5.1.2	Způsoby řešení problému multikolinearity	73

4	5.2 Technika umělých proměnných	82
	5.3 Zpožděné proměnné a modely rozdělených zpoždění	90
	5.3.1 Zpožděné exogenní proměnné	90
	5.3.2 Zpožděné endogenní proměnné	98
	5.4 Chyby specifikace a měření	103
	5.4.1 Nesprávná specifikace modelu	103
	5.4.2 Chyby v proměnných	105
	5.5 Agregace	111
	5.5.1 Lineární agregace ekonomických vztahů	111
	5.5.2 Vztah mezi parametry mikroekonomického a makroekonomického modelu	113
	Literatura	117
	Cvičení	120
6	MODEL SIMULTÁNNÍCH ROVNIC	123
M	6.1 Základní tvary modelu lineárních simultánních rovnic	123
	6.1.1 Strukturní tvar	124
	6.1.2 Redukovaný tvar	125
	6.1.3 Konečný tvar	127
	6.2 Identifikace soustavy simultánních rovnic	132
	6.2.1 Význam a způsoby identifikace	133
	6.2.2 Podmínky identifikace strukturní rovnice	136
	6.3 Rekursivní strukturní model	140
	Literatura	145
	Cvičení	146
M	7 ZPŮSOBY ODHADU SIMULTÁNNÍCH ROVNIC	147
	7.1 Metody omezené informace	147
	7.1.1 Metoda nepřímých nejmenších čtverců	150
	7.1.2 Metoda dvoustupňových nejmenších čtverců	153
	7.1.3 Metoda maximální věrohodnosti	161
	7.1.4 Odhadové funkce třídy k	164
	7.2 Metody úplné informace	166
	7.2.1 Metoda třístupňových nejmenších čtverců	166
	7.2.2 Metoda maximální věrohodnosti	171
R	7.3 Odhad redukovaného tvaru modelu	174
	7.3.1 Kovarianční matice odhadů parametrů redukovaného tvaru	175
	7.3.2 Odhadnutý redukovaný tvar a předpověď	177
	7.4 Volba odhadových funkcí a vztahy mezi nimi	184
	Literatura	186
	Cvičení	188
8	SIMULAČNÍ METODY V EKONOMETRICKÉM MODELOVÁNÍ	191
	8.1 Obecný postup při simulaci v ekonometrii	192
	8.2 Monte Carlo experiment s modelem simultánních rovnic	195
	8.3 Volba odhadové funkce při malých výběrech	198
	8.4 Ekonometrické prognózování a simulační postupy	206
	8.5 Simulace a ekonometrické modely optimálního řízení	210
	8.5.1 Vyhodnocení různých variant hospodářské politiky	212
	Literatura	216
	Cvičení	218