

OBSAH

Úvod	7
1 Ekonometria ako nástroj ekonomickej analýzy a prognózy	11
1.1 Historický vývoj ekonometrie a jej aplikácií	11
1.2 Definícia ekonometrie	15
1.3 Úloha ekonometrie v socialistickej ekonómii	18
2 Základné pojmy ekonometrického modelovania.	21
2.1 Naivné modely	22
2.2 Modely trendu a modely sezónneho vývoja	25
2.2.1 Modely trendu	25
2.2.2 Modely sezónnosti	37
2.3 Ekonometrické modely	42
2.3.1 Všeobecná charakteristika ekonometrického modelu	42
2.3.2 Druhy ekonometrických modelov	46
2.3.3 Fázy ekonometrického modelovania	49
2.3.4 Štatistická údajová základňa	53
3 Jednorovnicový (čiastkový) ekonometrický model	56
3.1 Maticový zápis modelu	56
3.2 Odhad parametrov jednoduchou metódou najmenších štvorcov.	60
3.3 Štatistická verifikácia modelu	70
3.3.1 Štatistická významnosť parametrov a modelu	70
3.3.2 Autokorelácia reziduí	75
3.3.3 Heteroskedasticita	82
3.3.4 Problém multikolinearity	86
3.4 Základné modifikácie metódy najmenších štvorcov	91
3.4.1 Koyckova a autoregresívna transformácia regresných rovníc	92
3.4.2 Zovšeobecnená metóda najmenších štvorcov	100
3.4.3 Metóda najmenších štvorcov s vedľajšími podmienkami	105
3.4.4 Metóda hlavných komponentov	109
3.5 Prognostická aplikácia modelu	114
3.6 Niektoré problémy nelineárnych modelov	120
4 Ekonomická interpretácia čiastkového modelu	123
4.1 Všeobecné problémy ekonomickej interpretácie modelu	123
4.1.1 Špecifikácia premenných a ich vzťahov v ekonometrickom modeli	123
4.1.2 Analýza elasticity vzťahov ekonomických veličín.	127

4.2	Modely výroby	130
4.2.1	Statické modely výroby	132
4.2.2	Dynamické modely výroby	141
4.2.3	Interpretácia modelov výroby z hľadiska ich kvantifikácie	147
4.3	Modely spotreby	149
4.3.1	Základné ekonomické hypotézy modelov spotreby	151
4.3.2	Dezagregácia modelov spotreby	156
4.3.3	Problémy špecifikácie a kvantifikácie modelov spotreby	158
4.4	Niektoré iné čiastkové modely	160
4.4.1	Modely investícií a základných fondov	160
4.4.2	Modely zamestnanosti	165
4.4.3	Modely priemerných miezd a mzdových príjmov	167
4.4.4	Modely zahraničného obchodu	169
4.5	Problém identifikácie hypotézy modelu	171
5	Viacrovnivový (komplexný) ekonometrický model	172
5.1	Maticový zápis komplexného ekonometrického modelu	174
5.1.1	Interpretačný zápis modelu	175
5.1.2	Kvantifikačný zápis modelu	178
5.2	Rekurzívny a interdependentný systém	181
5.3	Štrukturálna a redukovaná forma modelu	183
5.4	Identifikácia komplexného ekonometrického modelu	187
5.5	Všeobecné problémy konštrukcie komplexných ekonometrických modelov	194
6	Metódy odhadu parametrov viacrovnivového modelu	199
6.1	Podmienky pre aplikáciu metódy najmenších štvorcov	199
6.2	Simultánne metódy odhadu parametrov	207
6.2.1	Dvojstupňová metóda najmenších štvorcov	207
6.2.2	Metóda inštrumentálnych premenných	212
6.2.3	Dvojstupňové metódy s použitím hlavných komponentov	217
6.2.4	Iné metódy s obmedzenými informáciami	223
6.2.5	Metódy s úplnými informáciami a iteračné metódy	225
6.3	Súhrnné zhodnotenie vlastností jednotlivých metód	228
7	Verifikácia, interpretácia a aplikácia viacrovnivového ekonometrického modelu	232
7.1	Verifikácia modelu	232
7.1.1	Analýza odvodennej redukovanej formy modelu	232
7.1.2	Analýza aplikácie modelu ex post a súhrnná verifikácia modelu	236
7.2	Ekonomická interpretácia modelu	240
7.2.1	Obsah a štruktúra viacrovnivového modelu	240
7.2.2	Analýza a interpretácia multiplikátorov	246
7.3	Simulačná a prognostická aplikácia modelu	250
7.3.1	Simulačné aplikácie viacrovnivových modelov	250
7.3.2	Prognostické aplikácie viacrovnivových modelov	254
7.3.3	Použitie metód optimálneho riadenia pri prognostických aplikáciách ekonometrických modelov	257
	Príloha : Základné tabuľky na testovanie štatistických hypotéz	261
	Literatúra	277
	Register	280