

OBSAH

Předmluva	5
1. PROGRAMOVÝ SYSTÉM SORITEC	7
1.1 Úvod do systému	7
1.2 Datové objekty	11
1.3 Vstup dat	14
1.4 Výstup dat	17
1.5 Modifikace dat	19
1.6 Vybrané příkazy SORITECu	25
1.7 Vnitřní proměnné	27
2. ODHAD LINEÁRNÍHO REGRESNÍHO MODELU	31
2.1 Příkaz REGRESS	32
2.2 Odhad parametrů lineárního regresního modelu	35
2.3 Testování modelu jako celku	48
2.4 Predikce v ekonometrickém modelu	50
3. SPECIÁLNÍ ÚPRAVY REGRESNÍHO MODELU	55
3.1 Endogenní zpožděné proměnné v modelu	55
3.2 Umělé proměnné v ekonometrickém modelu	60
3.3 Linearizace regresního modelu	62
4. PŘEDPOKLADY MNČ	65
4.1 Autokorelace náhodných složek	65
4.2 Heteroskedasticita	71
4.3 Multikolinearita	78
5. SIMULTÁNNÍ SYSTÉMY MODELŮ	85
5.1 Tvary simultánních rovnic	85
5.2 Identifikace soustavy simultánních rovnic	87
5.3 Volba odhadové funkce pro odhady parametrů	89
5.4 Odhad parametrů v SORITECu	90

6. APLIKACE EKONOMETRICKÝCH MODELŮ	95
6.1 Poptávkové funkce	95
6.2 Modely vybavenosti a poptávky po zboží dlouhodobé spotřeby	102
6.3 Produkční funkce	106
6.4 Investiční funkce	113
6.5 Modely s body zvratu	118
7. ŘEŠENÍ EKONOMETRICKÝCH ÚLOH V SYSTÉMU QUATTRO PRO	123
7.1 Komunikace se systémem	123
7.2 Práce s daty	125
7.3 Numerické operace a standardní funkce	132
7.4 Odhad lineárního regresního modelu	134
7.5 Statistická verifikace odhadu parametrů	140
7.6 Porušení předpokladů MNČ	143
Literatura	147
Přílohy	149