

TREŚĆ

WSTĘP	7
1. PRZYZYNOWO-SKUTKOWE MODELE EKONOMETRYCZNE	9
1.1. Wprowadzenie	9
1.2. Klasyfikacja zmiennych	10
1.3. Klasyfikacja modeli przyczynowo-skutkowych	21
1.4. Uwagi na temat podstawowych zagadnień dotyczących modeli ekonometrycznych	32
Literatura cytowana	40
2. IDENTYFIKACJA	41
2.1. Uwagi wstępne	41
2.2. Podstawowe oznaczenia i definicje	41
2.3. Kryteria identyfikacji	47
2.4. Identyfikacja przy warunkach pobocznych	64
Literatura cytowana	75
3. METODY ESTYMACJI POJEDYNCZEJ MODELI PROSTYCH I REKURENCYJNYCH	76
3.1. Uwagi ogólne	76
3.2. Metoda najmniejszych kwadratów	78
3.3. Metoda największej wiarygodności	104
3.4. Uwagi o testach istotności dotyczących parametrów strukturalnych modelu ekonometrycznego	107
Literatura cytowana	113
4. METODY ESTYMACJI POJEDYNCZEJ MODELI O RÓWNANIACH WSPÓLZALEŻNYCH	114
4.1. Uwagi ogólne	114
4.2. Estymacja modeli niejednoznacznie identyfikowalnych	115
4.3. Estymacja modeli jednoznacznie identyfikowalnych	134
4.4. Metoda estymatorów klasy K	138

4.5. Podwójna metoda najmniejszych kwadratów oraz metoda minimalnego ilorazu wariancji w przypadku estymacji modelu jednoznacznie identyfikowalnego	144
Literatura cytowana	148
5. METODY ESTYMACJI PRZY WARUNKACH POBOCZNYCH	149
5.1. Uwagi wstępne	149
5.2. Estymacja przy warunkach pobocznych modeli prostych i rekurencyjnych	150
5.3. Estymacja przy warunkach pobocznych modeli współzależnych	171
Literatura cytowana	181
6. ŁĄCZNA ESTYMACJA MODELI EKONOMETRYCZNYCH	183
6.1. Uwagi ogólne	183
6.2. Łączna estymacja modeli prostych	186
6.3. Potrójna metoda najmniejszych kwadratów	190
Literatura cytowana	195