

Cuprins

Cuvânt-înainte	7
Capitolul 1. Introducere în econometrie	9
1.1. Breviar teoretic.....	9
1.1.1. Definirea și caracterizarea econometriei.....	9
1.1.2. Rolul econometriei în economie	10
1.1.3. Tipuri de abordări în econometrie.....	10
1.1.4. Natura și sursa datelor folosite în analiza econometrică	11
1.2. Aplicații rezolvate	12
1.3. Aplicații propuse	27
Capitolul 2. Teste statistice	29
2.1. Breviar teoretic.....	29
2.1.1. Testarea ipotezelor parametrice	29
2.1.2. Teste referitoare la parametrii repartiției normale	31
2.2. Aplicații rezolvate	41
2.3. Aplicații propuse	47
Capitolul 3. Modelul simplu de regresie	49
3.1. Breviar teoretic.....	49
3.1.1. Definirea și caracterizarea analizei de regresie	49
3.1.2. Specificarea dependenței regresiei simple de alte caracteristici ale variabilelor	50
3.1.3. Modelul clasic de regresie liniară	51
3.1.4. Estimarea parametrilor modelului clasic de regresie liniară	53
3.2. Aplicații rezolvate	59
3.3. Aplicații propuse	70
Capitolul 4. Modelul simplu de regresie – inferența statistică	75
4.1. Breviar teoretic.....	75
4.1.1. Inferența statistică în modelul de regresie liniară simplă	75
4.1.2. Analiza varianței în cazul modelului de regresie liniară simplă	76
4.1.3. Predicții cu ajutorul modelului de regresie liniară simplă.....	77
4.2. Aplicații rezolvate	78
4.3. Aplicații propuse	83
Capitolul 5. Regresia multiplă	91
5.1. Breviar teoretic.....	91
5.1.1. Definirea și caracterizarea analizei de regresie multiplă.....	91
5.1.2. Modelul de regresie liniară multiplă, cazul $m = 2$	93
5.1.3. Studiul matriceal al modelelor de regresie liniară multiplă	95
5.2. Aplicații rezolvate	97
5.3. Aplicații propuse	104
Capitolul 6. Modele neliniare	113
6.1. Breviar teoretic.....	113
6.1.1. Tipuri de modele neliniare	113
6.1.2. Liniarizarea prin transformarea Box-Cox	114

6.2. Aplicații rezolvate	116
6.3. Aplicații propuse	121
Capitolul 7. Autocorelarea erorilor	125
7.1. Breviar teoretic	125
7.1.1. Introducere	125
7.1.2. Testul Durbin-Watson	125
7.1.3. Procedee de estimare în cazul erorilor autocorelate	127
7.1.4. Modele ARCH	128
7.2. Aplicații rezolvate	129
7.3. Aplicații propuse	142
Capitolul 8. Heteroscedasticitatea	145
8.1. Breviar teoretic	145
8.1.1. Caracteristici generale	145
8.1.2. Detectarea heteroscedasticității	145
8.2. Aplicații rezolvate	148
8.3. Aplicații propuse	153
Capitolul 9. Multicoliniaritatea	157
9.1. Breviar teoretic	157
9.1.1. Introducere	157
9.1.2. Măsuri statistice ale multicoliniarității	158
9.1.3. Eliminarea de variabile din modelul econometric	159
9.2. Aplicații rezolvate	160
9.3. Aplicații propuse	166
Capitolul 10. Modele cu ecuații simultane	169
10.1. Breviar teoretic	169
10.1.1. Introducere	169
10.1.2. Modele cu ecuații simultane	169
10.1.3. Metode de estimare a modelelor cu ecuații simultane: metoda variabilelor instrumentale	171
10.2. Aplicații rezolvate	176
10.3. Aplicații propuse	186
Capitolul 11. Analiza seriilor de timp	189
11.1. Breviar teoretic	189
11.1.1. Introducere în analiza seriilor de timp	189
11.1.2. Tipuri de serii de timp reprezentative	190
11.1.3. Procedee Box-Jenkins	195
11.1.4. Etapele analizei seriei de timp folosind EViews	198
11.2. Aplicații rezolvate	209
11.3. Aplicații propuse	220
Bibliografie	223
Anexe	225