

SADRŽAJ

1. UVODNA RAZMATRANJA	1
1.1 PREDMET EKONOMETRIJE	1
1.2 MODELI	2
1.3 EKONOMETRIJSKI POSTUPAK	4
2. LINEARNI REGRESIONI MODELI	7
2.1 UVOD	7
2.2 LINEARNI REGRESIONI MODEL SA DVE PROMENLJIVE	11
2.2.1 OCENJIVANJE PARAMETARA METODOM MNK	12
2.2.2 KOEFICIJENT KORELACIJE I DETERMINACIJE	20
2.2.3 STATISTIČKI TESTOVI	23
2.2.4 ANALIZA VARIJACIJA	27
2.2.5 SVOĐENJE NELINEARNIH NA LINEARNI MODEL	29
2.2.6 PREDVIĐANJA	30
2.3 LINEARNI REGRESIONI MODEL SA VIŠE PROMENLJIVIH	32
2.3.1 OCENJIVANJE PARAMETARA METODOM MNK	33
2.3.2 KORELACIONA MATRICA	36
2.3.3 STATISTIČKI TESTOVI	38
2.3.4 PREDVIĐANJE	39
3. SPECIJALNI PROBLEMI REGRESIONIH MODELA	42
3.1 UVOD	42
3.2 MULTIKOLINEARNOST	43
3.3 LAŽNE (VEŠTAČKE) PROMENLJIVE	46
3.4 HETEROSKEDASTIČNOST	50
3.5 UOPŠTENA METODA NAJMANJIH KVADRATA	54
3.6 AUTOKORELACIJA	56
3.6.1 DURBIN-WATSON-OV TEST AUTOKORELACIJE	62
4. SIMULTANE JEDNAČINE	63
4.1 UVOD	63
4.2 IDENTIFIKACIJA	65
4.3 OCENJIVANJE PARAMETARA INDIREKTOM MNK	69
4.4 OCENJIVANJE PARAMETARA DVOSTEPENOM MNK	70
5. ANALIZA VREMENSKIH SERIJA	72
5.1 UVOD	72
5.2 TREND VREMENSKE SERIJE	74
5.2.1 METOD POKRETNIH SREDINA	75
5.2.2 ANALITIČKA METODA UTVRĐIVANJA TRENDIA	78
5.2.3 METOD EKSPONENCIJALNOG IZRAVNANJA	80
5.2.4 METODA HOLT-WINTERS-A	81
5.3 PRIMERI	83