

## CUPRINS

<b>Introducere .....</b>	<b>9</b>
<b>CAPITOLUL 1. Introducere în econometrie .....</b>	<b>11</b>
<b>1.1 Ce este econometria? .....</b>	<b>11</b>
<b>1.2 Modelul economic și modelul econometric .....</b>	<b>13</b>
<b>1.3 Despre factorul timp și variabilele întârziate .....</b>	<b>15</b>
<b>1.4 Etapele modelării econometrice.....</b>	<b>18</b>
<b>1.5 Medii de programare pentru econometrie .....</b>	<b>23</b>
<b>CAPITOLUL 2. Modelul clasic de regresie liniară -     regesia simplă .....</b>	<b>25</b>
<b>2.1 Introducere .....</b>	<b>25</b>
<b>2.2 Ce este un model de regresie? .....</b>	<b>26</b>
<b>2.3 Specificarea modelului de regresie simplă.....</b>	<b>27</b>
<b>2.4 Metoda celor mai mici pătrate (tehnica OLS).....</b>	<b>30</b>
<b>2.5 Ipoteze în modelul de regresie simplă .....</b>	<b>35</b>
<b>2.6 Proprietățile estimatorilor OLS.....</b>	<b>38</b>
<b>2.7 Metoda verosimilității maxime .....</b>	<b>42</b>
<b>2.8 Introducere în inferența statistică – verificarea unor         ipoteze statistice.....</b>	<b>43</b>
<b>2.9 Predicții pe baza modelului de regresie .....</b>	<b>49</b>
<b>2.10 Analiza varianței pentru modelul de regresie simplă.....</b>	<b>51</b>
<b>2.11 Forma matriceală a modelului de regresie liniară simplă .....</b>	<b>55</b>

<b>CAPITOLUL 3. Modelul de regresie liniară multiplă .....</b>	<b>58</b>
3.1 Generalizarea modelului simplu la modelul multiplu de regresie liniară.....	59
3.2 Ipotezele modelului și estimatorii OLS .....	60
3.3 Proprietăți algebrice ale soluției OLS.....	61
3.4 Proprietăți statistice ale soluției OLS.....	62
3.5 Inferențe statistice .....	66
3.6 Analiza varianței pentru modelul de regresie multiplă.....	70
3.7 Evaluarea ajustării prin modelul de regresie.....	71
3.8 Exemple de dependențe între variabile economice .....	74
 <b>CAPITOLUL 4. Probleme în date și alegerea modelului de regresie .....</b>	 <b>79</b>
4.1 Probleme în date .....	79
4.2 Alegerea modelului de regresie.....	83
 <b>CAPITOLUL 5. Ipotezele modelului liniar de regresie.</b>	
Testare și tratare .....	99
5.1 Ipoteza homoscedasticității .....	101
5.2 Ipoteza privind independența erorilor.....	106
5.3 Ipoteza privind ne-aleatoritatea matricei $X$ .....	114
5.4 Ipoteza privind normalitatea erorilor și testarea normalității .....	115
5.5 Adoptarea unei forme greșite în modelul de regresie. Testul lui Ramsey .....	118
5.6 Stabilitatea parametrilor modelului de regresie. Testul lui Chow .....	119
5.6 Omisiunea unei variabile importante.....	121

<b>CAPITOLUL 6. Modele cu ecuații simultane .....</b>	<b>122</b>
6.1 Despre covarianța estimată.....	122
6.2 Un model al funcției de consum.....	123
6.3 Utilizarea unei variabile instrumentale .....	126
6.4 Problema identificării.....	127
6.5 Problema supraidentificării și tehnica OLS în două etape (2SLS).....	134
 <b>CAPITOLUL 7. Modelarea seriilor de timp .....</b>	 <b>136</b>
7.1 Introducere .....	136
7.2 Tehnici generale de analiză .....	141
7.3 Modele pentru serii de timp staționare.....	155
7.4 Modele pentru serii de timp nestacionare.....	181
 <b>CAPITOLUL 8. Metode de predicție.....</b>	 <b>192</b>
8.1 Măsurarea acurateții predicției .....	192
8.2 Predicție prin medii mobile.....	197
8.3 Predicție folosind modele ARIMA .....	203
8.4 Predicție prin netezire exponențială.....	214
8.5 Metode de predicție pentru serii de timp cu sezonaliitate.....	225
 <b>Bibliografie .....</b>	 <b>231</b>