

## Obsah

<b>PŘEDMLUVA</b> .....	<b>9</b>
<b>1. DYNAMICKÉ MODELY ANALÝZY A PROGNÓZY POPTÁVKY</b>	<b>11</b>
1.1 Analýza vnitřní dynamiky vybavenosti PDS .....	11
1.1.1 Růstový logistický model a jeho odvození .....	13
1.1.2 Metody odhadu parametrů logistického modelu .....	18
1.2 Logistický model modifikovaný ekonomickými faktory .....	21
1.2.1 Vliv příjmu na vývoj poptávky a vybavenosti .....	22
1.2.2 Odhad nesymetrického logistického modelu .....	25
Klíčové pojmy .....	28
Cvičení a příklady .....	29
Literatura .....	30
<b>2. PRODUKČNÍ FUNKCE</b> .....	<b>33</b>
2.1 Podstata a význam produkčních funkcí .....	33
2.1.1 Vlastnosti neoklasických produkčních funkcí .....	34
2.1.2 Ekonomické charakteristiky produkčních funkcí .....	37
2.1.3 Základy teorie firmy .....	41
2.2 Ekonometrická analýza statických produkčních funkcí .....	43
2.2.1 Produkční funkce Cobba-Douglase .....	44
2.2.2 Odhad a ekor omická analýza PFC D .....	51
2.2.3 Možnosti zobecnění PFC D .....	58
2.2.4 Produkční funkce s konstantní pružností substituce .....	59
2.2.5 Odhad parametrů PFCES .....	65
2.3 Vliv technického pokroku a dynamické produkční funkce .....	67
2.3.1 Nezpředmětněný technický pokrok a jeho měření .....	67
2.3.2 Kvantifikace různých druhů technického pokroku .....	69
2.3.3 Odhad PFC D z časových řad .....	72
Klíčové pojmy .....	76
Cvičení a příklady .....	77
Literatura .....	79
<b>3. SPOTŘEBNÍ FUNKCE</b> .....	<b>83</b>
3.1 Teoretická východiska spotřebních funkcí .....	83
3.1.1 Hypotéza absolutního důchodu .....	83

3.1.2	Hypotéza relativního důchodu .....	84
3.1.3	Hypotéza životního cyklu .....	86
3.1.4	Hypotéza permanentního důchodu .....	87
3.1.5	Hypotéza racionálních očekávání .....	90
3.1.6	Spotřební funkce založené na modelu korekce chyby ..	93
3.2	Praktické problémy odhadu spotřebních funkcí .....	96
3.2.1	Odhad mikroekonomické keynesiánské SF .....	96
3.2.2	Ekonometrická analýza makroekonomické SF pro ČR ..	98
3.2.3	Aplikace hypotézy permanentního důchodu .....	102
3.2.4	Explicitní dynamizace agregátní SF .....	104
	Klíčové pojmy .....	106
	Cvičení a příklady .....	107
	Literatura .....	110
<b>4.</b>	<b>MODELÝ POPTÁVKY PO PENĚŽÍCH .....</b>	<b>113</b>
4.1	Specifikace modelů poptávky po penězích .....	114
4.1.1	Stabilita funkce poptávky po penězích .....	114
4.1.2	Konkrétní tvary modelů poptávky po penězích .....	115
4.2	Problémy odhadu poptávky po penězích .....	121
4.2.1	Odhad funkcí poptávky po penězích v ČR .....	122
4.2.2	Aplikace mocninné funkce poptávky po penězích .....	127
4.2.3	Testování specifikace a stability funkce poptávky po penězích .....	129
	Klíčové pojmy .....	131
	Cvičení a příklady .....	132
	Literatura .....	135
<b>5.</b>	<b>DYNAMICKÁ ANALÝZA INFLACE .....</b>	<b>139</b>
5.1	Ekonomická východiska inflační dynamiky .....	139
5.1.1	Phillipsova křivka .....	139
5.1.2	Neoklasická modifikace Phillipsovy křivky .....	140
5.1.3	Lucasův-Rappingův model .....	144
5.1.4	Caganův model adaptivních očekávání inflace .....	149
5.1.5	Model racionálních očekávání inflace .....	151
5.2	Aplikace ekonometrických modelů inflace v praxi .....	154

5.2.1	Analýza britské inflace pomocí Phillipsovy křivky . . . . .	154
5.2.2	Odhad rozšířené Phillipsovy křivky pro ČR . . . . .	155
5.2.3	Srovnání alternativních specifikací Phillipsovy křivky . .	157
5.2.4	Čtvrtletní model inflace v ČR . . . . .	160
5.2.5	Rekurzivní model cenové a mzdové inflace v ČR . . . . .	162
	Klíčové pojmy . . . . .	166
	Cvičení a příklady . . . . .	167
	Literatura . . . . .	172
<b>6.</b>	<b>MAKROEKONOMETRICKÉ MODELY . . . . .</b>	<b>175</b>
6.1	Struktura a proměnné makroekonomických modelů . . . . .	175
6.1.1	Vývoj teoretické struktury MEM . . . . .	176
6.1.2	Proměnné a bloky standardního MEM . . . . .	178
6.1.3	Specifikace modelů pro výběr hospodářské politiky . . .	179
6.2	Stručné charakteristiky vybraných MEM . . . . .	182
6.2.1	Modely ekonomiky USA . . . . .	183
6.2.2	Modely kanadské ekonomiky . . . . .	191
6.2.3	Modely britské ekonomiky . . . . .	195
6.3	Příklady odhadu a využití MEM . . . . .	198
6.3.1	Analýza výsledků Kleinova modelu I . . . . .	199
6.3.2	Interpretace a zhodnocení odhadnutého St.Louiského modelu . . . . .	203
6.3.3	Srovnání odhadů alternativně specifikovaného MEM pro ČR . . . . .	207
6.3.4	Odhad a interpretace IS-LM modelu české ekonomiky .	210
	Klíčové pojmy . . . . .	214
	Cvičení a příklady . . . . .	215
	Literatura . . . . .	219
<b>7.</b>	<b>MODELY DISKRÉTNÍ VOLBY . . . . .</b>	<b>223</b>
7.1	Modely binární diskrétní volby . . . . .	223
7.1.1	Lineární pravděpodobnostní model . . . . .	224
7.1.2	Modifikace modelu binární volby . . . . .	226
7.1.3	Probitový model . . . . .	230
7.1.4	Logitový model . . . . .	231
7.1.5	Predikce pomocí modelů binární diskrétní volby . . . . .	234
7.1.6	Měření shody modelů binární volby s daty . . . . .	235
7.2	Modely multinomické diskrétní volby . . . . .	237
7.2.1	Model podmíněných logitů . . . . .	240
7.2.2	Model podmíněných probitů . . . . .	244
7.3	Postup při odhadu modelů binární diskrétní volby . . . . .	245

7.3.1	Odhad parametrů lineárního pravděpodobnostního modelu .....	245
7.3.2	Anticipace vybavenosti domácností pomocí nelineárních modelů binární volby .....	247
7.3.3	Predikce výsledků binární volby v závislosti na více faktorech .....	250
	Klíčové pojmy .....	253
	Cvičení a příklady .....	254
	Literatura .....	256
	<b>REJSTŘÍK</b> .....	<b>259</b>