

I 12

Obsah

PŘEDMLUVA 7

1. DYNAMICKÉ MODELÝ ANALÝZY A PROGNOZY
 POPTÁVKY 9

1.1 Analýza vnitřní dynamiky vybavenosti PDS 10

1.1.1 Růstový logistický model a jeho odvození 12

1.1.2 Metody odhadu parametrů logistického modelu 17

1.2 Logistický model modifikovaný ekonomickými faktory 22

1.2.1 Vliv příjmu na vývoj poptávky a vybavenosti 23

1.2.2 Odhad nesymetrického logistického modelu 27

Klíčové pojmy 31

Cvičení a příklady 32

Literatura 33

2. PRODUKČNÍ FUNKCE 35

2.1 Podstata a význam produkčních funkcí 35

2.1.1 Vlastnosti neoklasických produkčních funkcí 37

2.1.2 Ekonomické charakteristiky produkčních funkcí 40

2.1.3 Základy teorie firmy 44

2.2 Ekonometrická analýza statických produkčních funkcí 48

2.2.1 Produkční funkce Cobba-Douglase 49

2.2.2 Odhad a ekonomická analýza PFCD 57

2.2.3 Možnosti zobecnění PFCD 65

2.2.4 Produkční funkce s konstantní pružností substituce 67

2.2.5 Odhad parametrů PFCES 75

2.3 Vliv technického pokroku a dynamické produkční funkce 77

2.3.1 Nezpředmětněný technický pokrok a jeho měření 77

2.3.2 Kvantifikace různých typů technického pokroku 81

2.3.3 Odhad PFCD z časových řad 85

Klíčové pojmy 89

Cvičení a příklady 90

Literatura 92

3. SPOTŘEBNÍ FUNKCE 95

3.1 Teoretická východiska spotřebních funkcí 95

3.1.1	Hypotéza absolutního důchodu	96
3.1.2	Hypotéza relativního důchodu	97
3.1.3	Hypotéza životního cyklu	99
3.1.4	Hypotéza permanentního důchodu	101
3.1.5	Hypotéza racionálních očekávání	105
3.1.6	Spotřební funkce založené na modelu korekce chyby	109
3.2	Praktické problémy odhadu spotřebních funkcí	113
3.2.1	Odhad mikroekonomické keynesiánské SF	113
3.2.2	Ekonometrická analýza makroekonomické SF pro ČR	116
3.2.3	Aplikace hypotézy permanentního důchodu	121
3.2.4	Explicitní dynamizace agregátní SF	123
	Klíčové pojmy	126
	Cvičení a příklady	127
	Literatura	130
4.	MODELÝ POPTÁVKY PO PENĚŽÍCH	133
4.1	Specifikace modelů poptávky po penězích	134
4.1.1	Stabilita funkce poptávky po penězích	134
4.1.2	Konkrétní tvary modelů poptávky po penězích	135
4.2	Problémy odhadu poptávky po penězích	144
4.2.1	Odhad funkcí poptávky po penězích v ČR	146
4.2.2	Aplikace mocninné funkce poptávky po penězích	152
4.2.3	Testování specifikace a stability funkce poptávky po penězích	155
	Klíčové pojmy	158
	Cvičení a příklady	159
	Literatura	162
5.	DYNAMICKÁ ANALÝZA INFLACE	165
5.1	Ekonomická východiska inflační dynamiky	165
5.1.1	Phillipsova křivka	166
5.1.2	Neoklasická modifikace Phillipsovy křivky	167
5.1.3	Lucasův-Rappingův model	172
5.1.4	Caganův model adaptivních očekávání inflace	179
5.1.5	Model racionálních očekávání inflace	182
5.2	Aplikace ekonometrických modelů inflace v praxi	186
5.2.1	Analýza britské inflace pomocí Phillipsovy křivky	186
5.2.2	Odhad rozšířené Phillipsovy křivky pro ČR	187
5.2.3	Srovnání alternativních specifikací Phillipsovy křivky	190

5.2.4	Čtvrtletní model inflace v ČR	194
5.2.5	Rekurzivní model cenové a mzdové inflace v ČR	196
	Klíčové pojmy	202
	Cvičení a příklady	203
	Literatura	208
6.	MAKROEKONOMETRICKÉ MODELY	210
6.1	Struktura a proměnné makroekonomických modelů	211
6.1.1	Vývoj teoretické struktury MEM	212
6.1.2	Proměnné a bloky standardního MEM	215
6.1.3	Specifikace modelů pro výběr hospodářské politiky	216
6.2	Stručné charakteristiky vybraných MEM	219
6.2.1	Modely ekonomiky USA	220
6.2.2	Modely kanadské ekonomiky	232
6.2.3	Modely britské ekonomiky	237
6.3	Příklady odhadu a využití MEM	241
6.3.1	Analýza výsledků Kleinova modelu I.	242
6.3.2	Interpretace a zhodnocení odhadnutého St. Louiského modelu	248
6.3.3	Srovnání odhadů alternativně specifikovaného MEM pro ČR	253
6.3.4	Odhad a interpretace IS-LM modelu české ekonomiky	257
	Klíčové pojmy	262
	Cvičení a příklady	263
	Literatura	267