

Ú v o d	5
ČÁST 1 REGRESE A KORELACE	8
1.1 Pojem regrese a korelace	8
1.2 Cíl regresní analýzy	10
1.3 Vyrovňovací kritéria	11
1.4 Přesnost regresních funkcí a intenzita závislosti	22
1.5 Testy hypotéz o korelačních koeficientech	45
ČÁST 2 LINEÁRNÍ REGRESNÍ MODEL	51
2.1 Modely a modelování	51
2.1.1 Pojmy model, matematický model, stochastický model	51
2.1.2 Modely zobrazující regresní vztahy mezi veličinami	55
2.1.3 Nejpoužívanější typy jednorovnicových regresních modelů	57
2.2 Klasický lineární regresní model	64
2.2.1 Podmínky klasického lineárního modelu..	65
2.2.2 Bodové odhady parametrů klasického lineárního modelu	68
2.2.3 Intervaly spolehlivosti a testy hypotéz pro parametry klasického lineárního modelu	88
2.3 Volba regresní funkce	97
2.3.1 Obecná kritéria volby regresní funkce..	97
2.3.2 Věcně-ekonomická kritéria	100
2.3.3 Matematicko-statistická kritéria	102
2.4 Vysvětlující proměnné	125
2.4.1 Individuální přínos vysvětlujících proměnných	126
2.4.2 Multikolinearita	129
2.4.3 Vysvětlující proměnné náhodnými veličinami	134

ČÁST 3	NĚKTERÁ ROZŠÍŘENÍ KLASICKÉHO LINEÁRNÍHO MODELU	139
3.1	Zobecněný lineární regresní model	139
3.2	Heteroskedastické náhodné poruchy	151
3.2.1	Modely heteroskedastických náhodných poruch	156
3.2.2	Testování heteroskedasticity	160
3.3	Závislé náhodné poruchy	165
3.3.1	Autoregresní schéma prvního řádu	167
3.3.2	Durbin-Watsonův test autokorelace	171
3.4	Využití doplňkových informací	179
3.4.1	Typy pomocných informací o parametrech..	179
3.4.2	Podmínková zobecněná metoda nejmenších čtverců	183
3.4.3	Odhady v restriktivním lineárním regresním modelu	188
3.4.4	Minimaxové odhady	195
3.4.5	Hřebenová regrese	210
Dodatek 1: A.	Některé věty z maticového počtu ...	222
B.	Některá rozšíření maticového počtu	228
Dodatek 2:	Vícerozměrné normální rozdělení	245
Tabulková část	256