

O B S A H

	str.
<u>Předmluva</u>	4
<u>Kapitola 1.</u>	
PŘEDMĚT EKONOMETRIE	8
1.1. Definice ekonometrie	8
1.2. Historický vývoj ekonometrie	10
1.3. Úloha ekonometrie v socialistické ekonomice	12
1.4. Příbuzné obory	13
1.5. Vztahy mezi ekonomickými proměnnými	14
<u>Kapitola 2.</u>	
POMOCNÁ TVRZENÍ	18
2.1. Věty o maticích	18
2.2. Některé poznámky ke statistickým odhadům	23
2.3. Některá další tvrzení z oblasti matematické statistiky a stochastických procesů	27
2.4. Metoda hlavních komponent	31
<u>Kapitola 3.</u>	
KLASICKÝ MODEL LINEÁRNÍ REGRESE	35
3.1. Popis modelu a odhad parametrů metodou nejmenších čtverců	35
3.2. Předpověď v modelu	44
3.3. Klasický normální model lineární regrese	46
3.4. Některé další poznámky ke klasickému modelu lineární regrese	55
<u>Kapitola 4.</u>	
ZOBECNĚNÝ MODEL LINEÁRNÍ REGRESE	65
4.1. Aitkenův odhad v zobecněném modelu lineární regrese	65

4.2.	Heteroskedasticita	68
4.3.	Autokorelace reziduí	70

Kapitola 5.

	SPECIÁLNÍ PROBLÉMY LINEÁRNÍ REGRESE	78
5.1.	Kvalitativní proměnné	78
5.2.	Využití apriorní informace při odhadu parametrů	83

Kapitola 6.

	VÍCEROZMĚRNÝ MODEL LINEÁRNÍ REGRESE A SOUSTAVA LINEÁRNÍCH REGRESNÍCH ROVNIC	91
6.1.	Vícerozměrný model lineární regrese	91
6.2.	Soustava lineárních regresních rovnic	98

Kapitola 7.

	LINEÁRNÍ REGRESE S NÁHODNÝMI REGRESORY	103
7.1.	Nezávislá stochastická lineární regrese	103
7.2.	Stochastická lineární autoregrese	108
7.3.	Současně nekorelovaná stochastická lineární regrese	113
7.4.	Obecná stochastická lineární regrese	114

Kapitola 8.

	SOUSTAVY SIMULTÁNNÍCH ROVNIC	122
8.1.	Strukturální tvar soustavy simultánních rovnic	125
8.2.	Redukovaný tvar soustavy simultánních rovnic	129
8.3.	Stochastická specifikace soustavy simultánních rovnic	130

Kapitola 9.

	PROBLÉM IDENTIFIKOVANOSTI A NEPŘÍMÁ METODA NEJMENŠÍCH ČTVERCŮ	136
9.1.	Odhad v redukovaném tvaru soustavy simultánních rovnic	136
9.2.	Problém identifikovanosti v soustavách simultánních rovnic	139

9.3. Nepřímá metoda nejmenších čtverců146
9.4. Rekurzivní systémy148

Kapitola 10.

METODY ODHADU PRO JEDNU ROVNICI SIMULTÁNNÍ SOUSTAVY	155
10.1. Dvoustupňová metoda nejmenších čtverců155
10.2. Odhady k-té třídy162
10.3. Metoda nejmenšího podílu rozptylů164

Kapitola 11.

METODY ODHADU PRO VŠECHNY ROVNICE SIMULTÁNNÍ SOUSTAVY	171
11.1. Třístupňová metoda nejmenších čtverců171
11.2. Metoda maximální věrohodnosti s úplnou informací175

Kapitola 12.

SROVNÁNÍ RŮZNÝCH METOD ODHADU V SOUSTAVÁCH SIMULTÁNNÍCH ROVNIC	179
---	-----

Kapitola 13.

NĚKTERÉ DALŠÍ PROBLÉMY	183
13.1. Odvozený odhad parametrů redukovaného tvaru.	.183
13.2. Agregace v lineárním modelu184
13.3. Nelineární modely186

<u>Literatura</u>190
-------------------	--------------