

ÚVOD	5
1 KLASICKÁ LINEÁRNÍ REGRESE	9
1.1 REGRESNÍ PŘÍMKA	10
1.1.1 FORMULACE MODELU	10
1.1.2 ODHAD PARAMETRŮ REGRESNÍ PŘÍMKY	11
1.1.3 VYHODNOCENÍ KVALITY MODELU	13
1.1.4 STATISTICKÉ VLASTNOSTI MODELU	14
1.1.5 STATISTICKÉ VLASTNOSTI REGRESNÍ PŘÍMKY	16
1.1.6 STATISTICKÁ INDUKCE	18
1.2 VÍCENÁSOBNÁ REGRESE	19
1.2.1 FORMULACE MODELU	20
1.2.2 ODHAD PARAMETRŮ MODELU U VÍCENÁSOBNÉ REGRESE	21
1.2.3 STATISTICKÉ VLASTNOSTI	22
1.2.4 STATISTICKÁ INDUKCE	23
1.2.5 ÚPRAVENÝ KOEFICIENT DETERMINACE	27
1.2.6 TEST MODELU	28
1.2.7 METODA MAXIMÁLNÍ VĚROHODNOSTI	28
2 PROBLÉMY V MODELU	33
2.1 MULTIKOLINEARITA	33
2.2 POČET REGRESORŮ	36
2.3 CHYBY MĚŘENÍ	36
2.3.1 CHYBY NA STRANĚ Y	37
2.3.2 CHYBY NA STRANĚ X	37
2.4 HETEROSKEDASTICITA	38
2.4.1 FORMULACE MODELU A DŮSLEDKY	38
2.4.2 ZOBECNĚNÁ METODA NEJMENŠÍCH ČTVERCŮ	40
2.4.3 GOLDFELDŮV-QUANDTŮV TEST	43
2.5 AUTOKORELACE	46
2.5.1 FORMULACE MODELU A DŮSLEDKY	46
2.5.2 AUTOKORELACE A ZOBECNĚNÁ METODA NEJMENŠÍCH ČTVERCŮ	48
2.5.3 DURBINŮV-WATSONŮV TEST	50
2.6 MODELY SE ZPOŽDĚNÝMI EXOGENNÍMI PROMĚNNÝMI	54
2.6.1 ALMONŮV MODEL	55
2.6.2 GEOMETRICKÝ MODEL	56
3 SOUSTAVY SIMULTÁNNÍCH ROVNIC	63
3.1 PROBLÉM IDENTIFIKACE	64
3.2 ODHAD PARAMETRŮ SOUSTAVY	69
3.2.1 NEPŘÍMÁ METODA NEJMENŠÍCH ČTVERCŮ	69
3.2.2 DVOUKROKOVÁ METODA NEJMENŠÍCH ČTVERCŮ	71

4	KLASICKÁ TEORIE ČASOVÝCH ŘAD.....	76
4.1	TRENDOVÁ SLOŽKA.....	77
4.1.1	LINEÁRNÍ TREND.....	78
4.1.2	KVADRATICKÝ TREND.....	80
4.1.3	EXPONENCIÁLNÍ TREND.....	82
4.1.4	MODIFIKOVANÝ EXPONENCIÁLNÍ TREND.....	85
4.1.5	LOGISTICKÝ TREND.....	88
4.1.6	GOMPERTZOVA KŘIVKA.....	92
4.1.7	VÝBĚR TRENDU.....	93
4.2	KLOUZAVÉ PRŮMĚRY.....	94
4.2.1	PROSTÉ KLOUZAVÉ PRŮMĚRY.....	95
4.2.2	VÁŽENÉ KLOUZAVÉ PRŮMĚRY.....	97
4.3	SEZÓNŇÍ SLOŽKA.....	99
4.3.1	JEDNODUCHÝ POPIS SEZÓNŇNOSTI.....	99
4.3.2	REGRESNÍ PŘÍSTUP – KONSTANTNÍ SEZÓNŇNOST.....	102
4.3.3	REGRESNÍ PŘÍSTUP – PROPORCIONÁLNÍ SEZÓNŇNOST.....	105
	ZÁVĚR.....	110
	SEZNAM POUŽITÉ LITERATURY.....	111
	PŘÍLOHA Č. 1 - TABULKY.....	112