

Obsah

1	Úvod do ekonometrie	6
1.1	Historie ekonometrie	6
1.2	Oblast využití a předmět ekonometrie	8
1.3	Specifika ekonometrie	9
1.4	Ekonometrický model	10
1.5	Ekonometrické modelování	12
1.6	Ekonometrická data	18
2	Regresní úloha	21
2.1	Regresní model	21
2.2	Členění regresních modelů	23
2.3	Aplikovaná regresní analýza	25
2.4	Volba funkční formy	29
3	Obyčejné nejmenší čtverce	35
3.1	Důvody využívání metody OLS	36
3.2	Vlastnosti metody OLS	36
3.3	Odhad úrovněvého modelu	36
3.4	Odhad modelu s jednou vysvětlující proměnnou	37
3.5	Odhad koeficientů regresního modelu se dvěma regresory	40
3.6	Odhad koeficientů vícerozměrného regresního modelu	42
3.7	Maticový zápis modelu vícenásobné regrese	43
4	Korelační analýza	45
4.1	Párový korelační koeficient	45
4.2	Vícenásobný koeficient korelace	50
4.3	Parciální (dílní) koeficient korelace	52
5	Hodnocení kvality regresního modelu	56
5.1	Kritéria kvality regresní rovnice	56
5.2	Rozklad proměnlivosti v regresní úloze	57
5.3	Koeficient determinace	59
5.4	Adjustovaný koeficient determinace	62
5.5	Informační kritéria	65
5.6	Další možnosti posouzení vhodnosti specifikace modelu	65

6	Testování statistických hypotéz v regresní a korelační úloze	67
6.1	Principy testování statistických hypotéz	67
6.2	Testování průkaznosti regresních parametrů	72
6.3	Testování průkaznosti regresního modelu	75
6.4	Interval spolehlivosti pro regresní koeficienty	78
6.5	Další testy využívané v ekonometrii	81
7	Klasický lineární regresní model a jeho předpoklady	85
7.1	Klasický lineární regresní model	85
7.2	Předpoklady klasického lineárního regresního modelu	85
7.3	Klasický předpoklad I	88
7.4	Klasický předpoklad II	95
7.5	Klasický předpoklad III	96
7.6	Klasický předpoklad IV	96
7.7	Klasický předpoklad V	100
7.8	Klasický předpoklad VI	103
7.9	Klasický předpoklad VII	108
7.10	Vlastnosti OLS odhadů při splněných klasických předpokladech	108
8	Úvod do analýzy časových řad	113
8.1	Vymezení pojmu časová řada	113
8.2	Cíl analýzy časových řad	113
8.3	Členění časových řad	114
8.4	Specifické problémy analýzy časových řad	116
8.5	Specifické problémy analýzy ekonomických časových řad	119
8.6	Odvozené ukazatele	127
8.7	Metody analýzy časových řad	130
9	Kvantitativní metody analýzy časových řad	133
9.1	Naivní modely	135
9.2	Dekompoziční metoda	135
9.3	Analýza trendu	137
9.4	Metody odhadu sezónní složky	141
9.5	Metody odhadu cyklické složky	145
9.6	Náhodná složka	145
9.7	Lineární filtry	152
9.8	Pokročilé metody analýzy časových řad	159
10	Seznam použité literatury	161