

Název předmětu: Vícerozměrné statistické metody KMI/VSME

Počet kreditů: 6

Hodinová dotace: 3/1

Návaznost předmětu: Úvod do počtu pravděpodobnosti a statistiky, Statistické modelování a analýza časových řad

Anotace:

Klasifikace vícerozměrných metod a strukturovaný přístup ke konstrukci vícerozměrného statistického modelu.

Cíl:

Předmět je povinný pro všechny programy magisterského studia zaměřeného na ekonomiku finance a řízení. Reflektuje současné trendy aplikace pokročilejších statistických technik v ekonomických a společenských vědách. Součástí předmětu je práce se statistickým softwarem.

Osnova:

- Vícerozměrná data a vícerozměrná rozdělení;
- přehled vícerozměrných metod a jejich členění;
- metoda hlavních komponent a explorační faktorová analýza;
- shluková a diskriminační analýza;
- kategoriální data;
- vícerozměrné škálování a korespondenční analýza;
- conjointní analýza;
- klasický lineární model – induktivní úsudky o jeho parametrech, intervaly spolehlivosti, testy hypotéz, diagnostika regresního modelu;
- proces hledání nejlepšího regresního modelu;
- obecný lineární model.