

Přílohy diplomové práce

Seznam příloh

Příloha 1 Autokorelace reziduí

```
Breusch-Godfreyův test pro autokorelaci prvního řádu
OLS, za použití pozorování 1997-2018 (T = 22)
Závisle proměnná: uhat
```

	koeficient	směr. chyba	t-podíl	p-hodnota
const	-0,0828650	11,4716	-0,007223	0,9943
mira_nezam	0,0514285	1,19743	0,04295	0,9662
nominal_mzdy	3,62620e-05	0,000442248	0,08199	0,9356
poc_dok_nem_2	-3,61574e-05	0,000288181	-0,1255	0,9016
uhat_1	0,0952274	0,259471	0,3670	0,7181

Neadjustovaný koeficient determinace = 0,007861

Testovací statistika: LMF = 0,134693,
s p-hodnotou = $P(F(1,17) > 0,134693) = 0,718$

Alternativní statistika: $TR^2 = 0,172938$,
s p-hodnotou = $P(\text{Chi-kvadrát}(1) > 0,172938) = 0,678$

Ljung-Box Q' = 0,164562,
s p-hodnotou = $P(\text{Chi-kvadrát}(1) > 0,164562) = 0,685$

Zdroj: vlastní zpracování pomocí programu Gretl

Příloha 2 Heteroskedasticita

```
Whiteův test heteroskedasticity
OLS, za použití pozorování 1998-2018 (T = 21)
Závisle proměnná: uhat^2
```

	koeficient	směr. chyba	t-podíl	p-hodnota
const	320,104	1445,70	0,2214	0,8288
mira_nezam	-71,6163	286,948	-0,2496	0,8075
nominal_mzdy	0,0904692	0,0973258	0,9296	0,3726
poc_dok_nem_2	-0,0574011	0,0371152	-1,547	0,1502
sq_mira_nezam	1,90103	14,0145	0,1356	0,8946
X2_X3	-0,00480533	0,00846653	-0,5676	0,5817
X2_X4	0,00437155	0,00314202	1,391	0,1916
sq_nominal_mzdy	-3,61347e-06	2,13615e-06	-1,692	0,1188
X3_X4	3,21830e-06	1,79837e-06	1,790	0,1011
sq_poc_dok_nem_2	-7,49309e-07	4,91553e-07	-1,524	0,1556

Neadjustovaný koeficient determinace = 0,613339

Testovací statistika: $TR^2 = 12,880129$,
s p-hodnotou = $P(\text{Chi-kvadrát}(9) > 12,880129) = 0,168106$

Zdroj: vlastní zpracování pomocí programu Gretl

Příloha 3 Normalita reziduí

```

Frekvenční rozdělení pro uhat18, poz. 10-30
počet tříd = 7, střední hodnota = 2,70683e-015, so = 5,98129

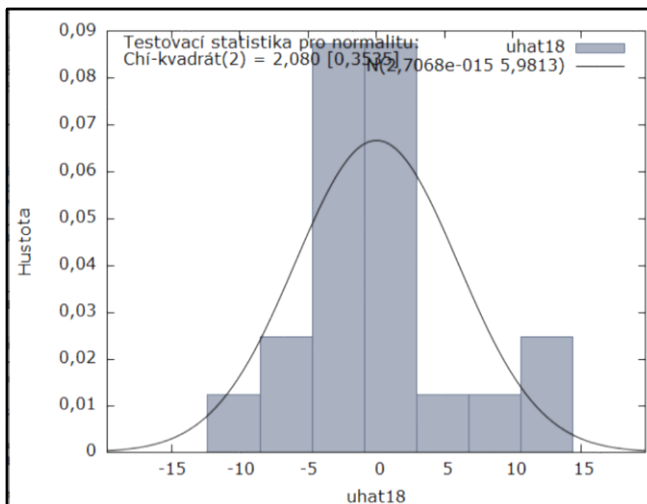
```

interval	střed	frequence	rel.	kum.
< -8,5487	-10,459	1	4,76%	4,76% *
-8,5487 - -4,7279	-6,6383	2	9,52%	14,29% ***
-4,7279 - -0,90707	-2,8175	7	33,33%	47,62% *****
-0,90707 - 2,9138	1,0033	7	33,33%	80,95% *****
2,9138 - 6,7346	4,8242	1	4,76%	85,71% *
6,7346 - 10,555	8,6450	1	4,76%	90,48% *
>= 10,555	12,466	2	9,52%	100,00% ***

Test nulové hypotézy normálního rozdělení:
Chi-kvadrát(2) = 2,080 s p-hodnotou 0,35354

Zdroj: vlastní zpracování pomocí programu Gretl

Příloha 4 Rozdělení náhodné složky podle normálního rozdělení



Zdroj: vlastní zpracování pomocí programu Gretl