

Cieľom tejto práce je predstaviť postup pre analýzu lineárneho regresného modelu s autokorelovanými reziduami, ktorý je vhodný v prípade, keď sú pozorovania získané sledovaním veličín v čase. Pre reziduá predpokladáme lineárny model ARMA, prípadne ARIMA, čo rozširuje možnosti využitia. Analýza takýchto regresných modelov zahŕňa detekciu autokorelovanosti a s tým súvisiace testy nekorelovanosti reziduí, detekciu stacionarity s testom jednotkového koreňa, ďalej identifikáciu modelu pre reziduá a odhad všetkých parametrov regresného modelu metódou maximálnej vierohodnosti.