

Abstrakt

V případě, že se v ekonometrické analýze setkáme s pozorováními, jejichž hodnoty vybočují z hodnot většiny pozorování, pak klasické metody, jako například metoda nejmenších čtverců, jsou náchylné k selhání. Problém odlehlých a vlivných pozorování může být překonán robustními metodami. Tato práce se zabývá použitím robustních metod pro panelová data - konkrétně robustními verzemi metod pevných a náhodných efektů, které jsou založeny na metodě nejmenších vážených čtverců. Po představení teoretických základů jsou uvedeny výsledky numerické studie. Jedná se o Monte Carlo studii, která ukazuje, jak se chovají klasické a robustní metody při různých stupních kontaminace dat a také, jak výběr váhové funkce může ovlivnit výsledek robustních metod založených na nejmenších vážených čtvercích.