

Abstrakt

V případě, že se v datasetu vyskytují hodnoty, které se výrazně liší od většiny ostatních hodnot (jako například odlehlá a vlivná pozorování), může být vhodné použít některou z robustních metod, abychom mohli z ekonometrické analýzy vyvodit relevantní závěry. Pro správné použití těchto metod potřebujeme diagnostické nástroje. Aby bylo možné tyto nástroje teoreticky odvodit, je nutné znát formu asymptotické reprezentace příslušného odhadu. V této práci je odvozena asymptotická reprezentace pro odhad získaný metodou nejmenších vážených čtverců, a to za předpokladu heteroskedastických reziduí. Těsnost mezi tímto odhadem a jeho asymptotickou reprezentací při různých stupních kontaminace je ukázána také v simulační studii.