

V řídkých lineárních regresních modelech je efekt majority vysvětlujících proměnných na podmíněnou střední hodnotu odezvy nulový. Odhady vyprodukované metodou adaptivní lasso jsou řídké a mají věštecké vlastnosti, čili asymptoticky přesně identifikují množinu nulových složek vektoru regresních koeficientů a jsou \sqrt{n} -konzistentními odhady nenulových regresních koeficientů. V první kapitole této diplomové práce jsou zopakovány vlastnosti odhadu metodou obyčejných nejmenších čtverců a uvedeny argumenty pro využití vychýlených regularizovaných odhadů. V druhé a třetí kapitole se zabýváme metodami lasso a adaptivní lasso. Ve čtvrté, závěrečné kapitole je diskutována problematika statistické inference po výběru rysů a odvozena metoda ke konstrukci přesných intervalových odhadů v lineárním regresním modelu, jehož množina vysvětlujících proměnných byla zvolena jako množina aktivních složek odhadu metodou lasso.