

# OBSAH

|  |     |
|--|-----|
| <b>ÚVOD</b> .....  | 5   |
| <b>1. ZÁKLADNÍ POJMY</b> .....   | 7   |
| 1.1 Ekonomické časové řady a jejich druhy .....  | 7   |
| 1.2 Časové řady ekonomických ukazatelů, základní popisné charakteristiky a míry dynamiky ..... | 8   |
| 1.2.1 Grafy .....  | 8   |
| 1.2.2 Základní popisné charakteristiky a míry dynamiky .....                                   | 13  |
| 1.2.3 Cvičení .....  | 22  |
| <b>2. MODELOVÁNÍ TRENDU A SEZÓNÍ SLOŽKY</b> .....  | 23  |
| 2.1 Dekompozice časových řad .....   | 23  |
| 2.2 Základní metody modelování trendové složky, konstrukce předpovědí .....                    | 24  |
| 2.2.1 Trendová analýza .....   | 24  |
| 2.2.2 Klouzavé průměry .....   | 44  |
| 2.2.3 Exponenciální vyrovnávání .....  | 51  |
| 2.2.4 Cvičení .....  | 60  |
| 2.3 Základní metody modelování sezónní složky, konstrukce předpovědí .....                     | 61  |
| 2.3.1 Identifikace sezónnosti .....  | 61  |
| 2.3.2 Regresní metoda modelování sezónnosti .....  | 69  |
| 2.3.3 Sezónní indexy .....   | 76  |
| 2.3.4 Winterovo exponenciální vyrovnávání .....  | 85  |
| 2.3.5 Cvičení .....  | 90  |
| <b>3. BOXOVA-JENKINSOVA METODOLOGIE</b> .....  | 91  |
| 3.1 Stochastický proces, jeho stacionarita a autokorelační struktura .....                     | 91  |
| 3.2 Stacionárních procesy .....  | 94  |
| 3.2.1 Procesy AR .....   | 94  |
| 3.2.2 Procesy MA .....   | 98  |
| 3.2.3 Procesy ARMA .....   | 102 |
| 3.3 Nestacionární a sezónní procesy .....  | 106 |
| 3.3.1 Procesy ARIMA .....  | 106 |
| 3.3.2 Procesy SARIMA .....   | 108 |
| 3.4 Identifikace a ověřování modelu, konstrukce předpovědí .....                               | 108 |
| 3.4.1 Identifikace modelu .....  | 108 |
| 3.4.2 Ověřování modelu .....   | 110 |
| 3.4.3 Výpočet předpovědí .....   | 112 |
| 3.4.4 Boxova-Jenkinsova metodologie ve STATGRAPHICSu .....                                     | 114 |
| 3.4.5 Cvičení .....  | 129 |
| <b>PŘÍLOHY</b> .....   | 131 |
| <b>LITERATURA</b> .....  | 147 |