
Obsah

1 Úvod	6
2 Zpoždění v modelu	9
2.1 Model rozdělených zpoždění	9
2.2 Autoregresní model rozdělených zpoždění	12
3 Funkční forma ekonometrického modelu a její volba	15
3.1 Obecná funkční forma	16
3.2 Odhad parametru λ	17
4 Praktická aplikace	19
4.1 Vztah úrokové sazby na nově čerpané clientské úvěry a úrokové sazby 1R PRIBOR	19
4.2 Vztah úrokové sazby na nově čerpané clientské úvěry a úrokové sazby 1R PRIBOR – analýza zkrácených časových řad	26
5 Závěr	35
Literatura	37