

Tato bakalářská práce se zabývá lineárními a nelineárními autoregresními modely pro časové řady z ekonomiky a financí. Je rozdělena na teoretickou a praktickou část. V teoretické části se čtenář seznámí s pojmy spojenými s náhodnými procesy, poté jsou zavedeny autoregresní a prahové autoregresní časové řady, odvodí se jejich obecné vlastnosti, popíší se možné způsoby předpovídání budoucích hodnot a ukáže se způsob odhadu parametrů. Dále se představí test linearity. Praktická část je rozdělena na simulační studii, ve které je zkoumána kvalita odhadů a síla testu na simulovaných časových řadách, a na aplikaci na reálná data, kde jsou tyto poznatky využity na časové řadě vývoje ceny akcií společnosti ČEZ.