

Abstrakt

Cieľom bakalárskej práce je teoretické spracovanie fungovania dvoch testov nelinearity - RESET testu a Keenanovho testu, a ich následné aplikovanie na finančné časové rady so zhrnutím dosiahnutých výsledkov. Pri testovaní predpokladáme, že časová rada odpovedá vopred určenému lineárnemu modelu $AR(p)$, ktorého rád je identifikovaný pomocou parciálnej autokorelačnej funkcie alebo kritéria AIC.