

Táto diplomová práca sa zaoberá využitím štatistických stavových modelov exponenciálneho vyrovnávania pri odhadovaní podmieneného pravdepodobnostného rozdelenia budúcich hodnôt časových radov. Jeho znalosť umožňuje počítať nielen bodové, ale aj intervalové predpovede. Práca popisuje metódy exponenciálneho vyrovnávania a zasadzuje ich do kontextu stavových modelov. Venuje sa analytickým postupom a simulačným metódam, využívaným pri výpočte intervalových predpovedí, konkrétne uvažuje simulácie založené na predpoklade normálneho rozdelenia, vychádzajúce z bootstrap metódy alebo na základe odhadnutého parametrického modelu. Obsahuje ukážku ich aplikácie na simulované aj na reálne dáta a porovnanie ich výsledkov.