

Název práce: Ekonometrická analýza finančních dat

Autor: Matúš Baniar

Katedra: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí diplomové práce: RNDr. Jitka Zichová, Dr., Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Abstrakt: Finanční a ekonomická data často obsahují kombinaci časové a průřezové informace. Při aplikaci matematických modelů na data takového charakteru může být vhodné uvažovat o soustavách ekonometrických rovnic. Na začátku práce se věnujeme jejich obecné formulaci, přičemž se zabýváme typy poměnných vstupujících do soustav. V další části popisujeme některé konkrétní případy: soustava SUR, soustava simultánních rovnic a model vektorové autoregrese. Pro tyto případy také popisujeme metody odhadování parametrů a pojednáváme o jejich vlastnostech. V poslední části jsou potom probrané metody aplikovány na reálná data s využitím vhodného softwaru.

Klíčová slova: exogenita, SUR soustava, simultánní rovnice, VAR