

Tato práce pojednává o analýze vícerozměrných finančních a ekonomických dat. V první části je vyložena teorie mnohorozměrných časových řad a ARMA modelu. Druhá část se věnuje modelům s exogenními proměnnými, konkrétně soustavě simultánních rovnic a ARMAX modelu. Třetí část se zabývá vyšetřováním vzájemné závislosti časových řad inflací a analýzou závislosti míry inflace na různých makroekonomických ukazatelích. Data byla zpracována softwary Mathematica 8, Mathematica 10, EViews a softwarem R.