

Práce se zabývá identifikací modelů finančních časových řad. Čtenář se seznámí s jednorozměrnými a mnohorozměrnými modely ARMA a způsoby jejich identifikace. Jsou představeny postupy, které využívají korelační strukturu časové řady, a také informační kritéria. Fungování jednotlivých postupů je ověřeno na simulovaných časových řadách AR, MA a ARMA. Kritéria jsou následně porovnána z hlediska spolehlivosti a jednoduchosti použití. Na závěr jsou uvedeny ukázky identifikace jednorozměrného a mnohorozměrného modelu ARMA pro reálné časové řady z finanční praxe. Použitá data a zdrojové kódy v programu R jsou k dispozici na přiloženém CD.