

Finanční data mají často podobu časových řad, v takových případech se jejich analýza provádí za pomoci statistických metod pro časové řady. V práci jsou popsány vybrané parametrické a neparametrické testy hypotézy náhodné procházky. Testy jsou konstruovány proti obecným alternativám vzájemné korelovanosti hodnot, ale i proti alternativám trendu a alternativám cyklické struktury dat. Práce poskytuje teoretická východiska těchto testů a také jejich aplikace na reálná finanční data.