

Bakalářská práce pojednává o příčinnosti ve vícerozměrných časových řadách. Ke studiu vzájemného vlivu složek vícerozměrných časových řad využívá Grangerovu kauzalitu a její obecnější varianty, kterými jsou okamžitá a více kroková kauzalita. Tyto pojmy jsou zkoumány v kontextu vektorových autoregresních modelů VAR. Po zavedení základní terminologie je popsána konstrukce takového modelu včetně identifikace řádu a diagnostických metod. Následně jsou zkoumány příslušné kauzální vazby v rámci vybudovaného modelu. Teoretická část práce je doplněna empirickou analýzou reálných tržních dat, provedenou pomocí vlastní implementace testovacích procedur v programu Mathematica.