

OBSAH

ÚVOD	5
1. ZÁKLADNÍ POJMY	7
1.1 Ekonomické časové řady a jejich druhy	7
1.2 Časové řady ekonomických ukazatelů, základní popisné charakteristiky a míry dynamiky	8
1.2.1 Grafy	8
1.2.2 Základní popisné charakteristiky a míry dynamiky	13
1.2.3 Cvičení	22
2. MODELOVÁNÍ TRENDU A SEZÓNŇNÍ SLOŽKY	23
2.1 Dekompozice časových řad	23
2.2 Základní metody modelování trendové složky, konstrukce předpovědi	24
2.2.1 Trendová analýza	24
2.2.2 Klouzavé průměry	44
2.2.3 Exponenciální vyrovnávání	51
2.2.4 Cvičení	60
2.3 Základní metody modelování sezónní složky, konstrukce předpovědi	61
2.3.1 Identifikace sezónnosti	61
2.3.2 Regresní metoda modelování sezónnosti	69
2.3.3 Sezónní indexy	76
2.3.4 Winterovo exponenciální vyrovnávání	85
2.3.5 Cvičení	90
3. BOXOVA-JENKINSOVA METODOLOGIE	91
3.1 Stochastický proces, jeho stacionarita a autokorelační struktura	91
3.2 Stacionárních procesy	94
3.2.1 Procesy AR	94
3.2.2 Procesy MA	98
3.2.3 Procesy ARMA	102
3.3 Nestacionární a sezónní procesy	106
3.3.1 Procesy ARIMA	106
3.3.2 Procesy SARIMA	108
3.4 Identifikace a ověřování modelu, konstrukce předpovědi	108
3.4.1 Identifikace modelu	108
3.4.2 Ověřování modelu	110
3.4.3 Výpočet předpovědi	112
3.4.4 Boxova-Jenkinsova metodologie ve STATGRAPHICSu	114
3.4.5 Cvičení	129
PŘÍLOHY	131
LITERATURA	147