

OBSAH

| | |
|--|----|
| 1. ELEMENTÁRNÍ CHARAKTERISTIKY | |
| 1.1 Základní pojmy | 7 |
| 1.2 Elementární statistické charakteristiky | 8 |
| 1.3 Rozdělení relativních výnosů | 12 |
| 2. PERIODICITA A FILTRY | |
| 2.1 Fourierova analýza | 15 |
| 2.2 Klouzavé průměry | 17 |
| 2.3 Exponenciální vyrovnávání | 20 |
| 3. BOX-JENKINS: STACIONÁRNÍ PROCESY | |
| 3.1 Základní pojmy | 23 |
| 3.2 Autoregresní procesy | 25 |
| 3.3 Procesy klouzavých součtů | 26 |
| 3.4 Smíšené procesy | 28 |
| 4. BOX-JENKINS: NESTACIONÁRNÍ PROCESY | |
| 4.1 Procesy ARIMA a ARFIMA | 29 |
| 4.2 Problémy ARIMA modelování | 32 |
| 5. MODEL Y PODMÍNĚNÉHO ROZPTYLU | |
| 5.1 Logaritmicko-normální autoregresní model | 37 |
| 5.2 Modely třídy ARCH | 41 |
| 5.3 Jiné nelineární stochastické modely | 44 |
| 6. LINEÁRNÍ DYNAMICKÉ SYSTÉMY | |
| 6.1 Stacionární lineární systémy | 47 |
| 6.2 Reolineární systémy | 51 |
| 6.3 Diferenční rovnice | 53 |
| 6.4 Kombinované systémy | 55 |

7. NELINEÁRNÍ DYNAMICKÉ SYSTÉMY

- 7.1 Základní charakteristiky nelineárních systémů** 59
- 7.2 Nelineární oscilace** 62
- 7.3 Deterministický chaos** 65
- 7.4 Kvantifikace chaotického chování** 67

8. R/S ANALÝZA

- 8.1 Fraktální dimenze** 73
- 8.2 Detekce cyklů** 74
- 8.3 Fraktální statistika** 79

9. TECHNICKÁ ANALÝZA

- 9.1 Cenové indikátory** 83
- 9.2 Objemové a ostatní indikátory** 90

10. MATEMATICKÉ DODATKY

- 10.1 Funkce beta a gama** 95
- 10.2 Diracova δ -funkce** 97
- 10.3 Laplaceova a Fourierova transformace** 99
- 10.4 Funkce komplexní proměnné** 102
- 10.5 Maticové operace** 105
- LITERATURA** 107