

Název předmětu: Statistické modelování a analýza časových řad KMI/SMCR

Počet kreditů: 6

Hodinová dotace: 3/1

Návaznost předmětu:

Anotace:

Modelování jednorozměrných ekonomických a finančních časových řad využití modelů pro konstrukci předpovědí.

Cíl:

Předmět je povinný pro posluchače bakalářského stupně všech studijních programů na ekonomické fakultě. Cílem je seznámit posluchače se základy práce s reálnými časovými řadami ukazatelů české ekonomiky. Probírá se zejména klasický model ekonomické časové řady (modely trendů, sezónnosti a cyklů ekonomických ukazatelů a jejich využití pro extrapolaci) sezónní a krátkodobé předpovědi. Na uživatelské úrovni bude popsána též Boxova-Jenkinsova metodologie. Významnou součástí tohoto předmětu je využití výpočetní techniky.

Osnova:

- Ekonomické časové řady a jejich základní vlastnosti;
- míry dynamiky ekonomických časových řad;
- klasický model ekonomických časových řad (trend, sezónnost, cyklus);
- základní modely sezónní složky a metody sezónního očišťování;
- principy konstrukce předpovědi;
- základy Boxovy-Jenkinsovy metodologie;
- modely finančních časových řad;
- praktické aplikace ekonomických a finančních časových řad, míry asociace a kontingence.