

# Aplikovaná ekonometrie a teorie časových řad – zápočtový test 2

Jméno: \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_ / 40 bodů

1. Uvažujte časovou řadu, kterou naleznete v souboru *test2\_priklad1*. Modelujte trend časové řady pomocí libovolné matematické křivky. Zvolte přitom nejvhodnější matematickou křivku pro modelování této řady a svou volbu vysvětlete.
2. Uvažujte časovou řadu, kterou naleznete v souboru *test2\_priklad2*. Modelujte časovou řadu s použitím Box-Jenkinsonovy metodologie. Zvolte nejlepší model (AR, MA, ARMA), ověřte podmínku stacionarity a invertibility. Svou volbu modelu vysvětlete.