DÚ:

- *zadáno*: 27. 2. 2009
- *odevzdání*: 27. 3. 2009, na cvičení, vytištěná podoba
- *zadání*: najděte dostatečně dlouhou libovolnou časovou řadu a tu odhadněte vhodným polynomiálním trendem – vysvětlující proměnné jsou pouze logický čas (odevzdání v tištěné podobě); stejnou časovou řadu odhadněte HP filtrem a Kalmanovým filtrem (filtrované nebo smoothané hodnoty) a porovnejte; používejte vždy stejná data, příp. použijte pro vysvětlení i pomocné časové řady (pokud si zvolíte časovou řadu ČR, použijte HP filtr s priorem); porovnejte trendovou i cyklickou složku; vhodně okomentujte a pokuste se vyvodit závěry
- *cíl*: oddělte trend a gap vybrané časové řady pomocí 3 různých technik, následně se pokuste získat stejný gap a trend u všech použitých postupů (jeden výsledek si zvolte jako výchozí)
- *doporučení*: kód v Matlabu jako příloha práce – bez dat a menším písmem, uvést zdroj dat; uvést výsledky a testovat předpoklady, všechno okomentovat – ale neuvádět věci na „zaplácání místa“, práce srozumitelná i bez nutnosti spuštění m-file v Matlabu, používejte grafické výstupy; uvést důsledky, když něco nevyjde; neuvádět samotná čísla, ale čeho se týkají a co znamenají; pokud data obsahují sezónnost, tak ji také modelovat → raději zvolit jinou časovou řadu; …), ...
- *poznámka*: bližší specifikace byla na cvičeních
- *upozornění*: nejde o striktní návod, pouze o hlavní body (kterých je vhodné ale ne nutné se držet)