

---

## BONUSOVÁ ÚLOHA K 5. SADĚ ÚLOH

---

TERMÍN ODEVZDÁNÍ: 20.5. 2013

5. Uvažujte denní kurz české koruny vůči euru dle České národní banky od začátku roku 2013 (zanedbejte, že pozorování nejsou pravidelná — chybí víkendy atd.). Data naleznete na

[http://www.cnb.cz/cs/financni\\_trhy/devizovy\\_trh/kurzy\\_devizoveho\\_trhu/vybrane\\_form.jsp](http://www.cnb.cz/cs/financni_trhy/devizovy_trh/kurzy_devizoveho_trhu/vybrane_form.jsp)

Pokuste se nalézt nějaký vhodný model pro tato data a pomocí něj predikujte kurz koruny vůči euru pro den 20.5.2013. Do řešení stačí velice stručně uvést odhadnutý výsledný model, pomocí nějž predikujete, a získanou predikci. Bodové ohodnocení úlohy se bude odvíjet od přesnosti Vaší predikce, a to následovně:

- predikce v intervalu  $\pm 0.01$  skutečná hodnota (v Kč)  $\longleftrightarrow$  10 bodů,
- predikce v intervalu  $\pm 0.05$  skutečná hodnota (v Kč)  $\longleftrightarrow$  8 bodů,
- predikce v intervalu  $\pm 0.1$  skutečná hodnota (v Kč)  $\longleftrightarrow$  5 bodů,
- predikce v intervalu  $\pm 0.2$  skutečná hodnota (v Kč)  $\longleftrightarrow$  2 body.

Bude-li predikce dále než 0.2 Kč od skutečné hodnoty, bude úloha za 0 bodů.