

Modelovanie vzájomných vzťahov výnosov na finančných trhoch

Cieľom práce je tvorba modelov výnosov finančných aktív, obchodovaných na rôznych finančných trhoch.

Vplyvom integrácie finančných trhov, ale aj dramatických udalostí v svetovej ekonomike dochádza k vzniku prepojenia výnosností finančných aktív, a to jednak v rámci národných trhov, ale aj medzi nimi. Tieto vzťahy je možné pozorovať tak v stredných hodnotách výnosností, ale aj ich volatilitách, prípadne v extrémnych hodnotách. Existencia vzájomných väzieb presahuje hranice čiastkových finančných trhov, z tohto dôvodu je možné skúmať aj vzťahy medzi rôznymi triedami finančných aktív. Pri napínaní cieľa dizertačnej práce sa predpokladá návrh investičných stratégií využívajúcich identifikované vzťahy pre zlepšenie ziskového, prípadne rizikového profilu investora.