

Abstrakt

Táto práca analyzuje finančnú nákazu medzi referenčným trhom EÚ - Nemeckom a trhmi piatich krajín, ktoré sa aktívne snažia stať súčasťou Európskej únie - Čiernej Hory, Srbska, Turecka, Bosny a Macedónska v období od marca 2006 do marca 2018. Aplikujeme kvantilovú regresiu na analýzu nákazy, ktorá sa zakladá na výskyte a stupni „coexceedances“ medzi referenčným a analyzovaným trhom. Výsledky naznačujú, že existuje nákaza medzi akciovými trhmi, avšak v rôznom rozsahu pre každý z analyzovaných trhov. Okrem toho používame rámec kvantilovej regresie špeciálne pre obdobie finančnej krízy z roku 2008, aby sme preukázali, že nákaza je silnejšia počas turbulentných období na trhu.

Klasifikace	G01, G14, G15
Klíčová slova	metóda coexceedance, kvantilová regresia, nákaza, akciové trhy
E-mail autora	80605682@fsv.cuni.cz
E-mail vedoucího práce	roman.horvath@fsv.cuni.cz