

Bakalářská práce se zabývá úrokovými měrami a výnosovými křivkami. Zavedeme si pojmy spotová úroková míra, forwardová úroková míra a diskontní faktor. Budeme používat tři modely k odhadu výnosových křivek, dva parametrické: Nelson-Siegelův model a Svenssonův model a jeden neparametrický: jádrový odhad. U každé metody si uvedeme funkce pro odhadnutí výnosových křivek a u parametrických modelů popíšeme jednotlivé parametry. Použité modely odhadů následně použijeme na reálných datech.