

Tato diplomová práce představuje několik modelů výnosových křivek. Vycházíme z dynamického modelu Nelson-Siegel, který jsme dále rozšířili pro modelování regionálních latentních faktorů a hlavních komponentů. Naši analýzu převážně zaměříme na střeoevropské výnosové křivky denominované v těchto měnách: CZK, HUF, PLN a SKK. V této práci představujeme dva původní modely, které zachycují regionální dynamiku: první založen na "state space framework" a druhý navíc využívá metody hlavních komponent regionálních výnosových křivek. Práce dále obsahuje dvě praktické aplikace modelů na řízení rizik a na detekci strukturálních změn. Hlavním přínosem této diplomové práce je vytvoření komplexního rámce, který umožňuje analýzu výnosových křivek, přípravu krizových scénářů a detekci strukturálních změn.