

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.

Hlavním přínosem této diplomové práce je vytvoření komplexního rámce, který umožňuje analýzu výnosových křivek, přípravu krizových scénářů a detekci strukturálních změn.