

Tato disertační práce se skládá ze tří kapitol, které se věnují aplikované ekonometrii finančních trhů střední Evropy.

První kapitola ("Rozdělení a dynamika středoevropských měnových kurzů : na evidenci intradenních dat") stanovuje pevný empirický rámec pro přesné modelování a předpovídání středoevropských měnových kurzů pomocí intradenních dat.

Druhá kapitola ("Volatility přenosu na devizových trzích střední Evropy") zkoumá dynamiku volatility přenosu mezi měnami střední Evropy (CE) a EUR / USD cizí měnou za použití modelu odhadu denní volatility směnného kurzu na základě intradenních dat.

Poslední třetí kapitola ("Závislost struktury na středoevropských kapitálových trzích") zkoumá existenci asymetrické závislosti struktury mezi středoevropskými a velkými západními akciovými trhy a její možné důsledky pro diverzifikaci portfolia a řízení rizik.