

Abstrakt

Tato dizertace obsahuje tři kapitoly, ve kterých jsou empiricky zkoumány klasické otázky bankovní rizika a finanční ekonomie. V první kapitole zkoumám jestli bankovní likvidita, kapitál a riziko jsou společně určeny v bankovním sektoru eurozóny. Ve druhé kapitole, spolu s Adamem Geršlem, Petrem Jakubíkem, Stevnem Ongena a José-Luis Peydró, zkoumáme roli měnových podmínek pro bankovní rizika v sektoru v ČR. Používáme komplexní úvěrového registru České národní banky. Třetí kapitola se vztahuje na modelové rizika a analyzuje výkonnost vybraného modelu výnosové křivky při oceňování úrokové swapy na polském trhu. Cox-Ingersoll-Ross navrhuje že volatilita souvisí s velikostí úrokových sazeb. Ex-post Nelson-Siegel model ukazuje, že průřez výnosové křivky je velmi informativní pro budoucnost.