

Táto práca sa zaoberá modelmi finančných časových radov a ich implementáciou v softvérových produktoch. Teoretická časť práce obsahuje popis modelov volatility ARCH, GARCH, IGARCH, ARCH-M a GARCH-M, EGARCH a GJR-GARCH a ich základných vlastností. Praktická časť skúma a popisuje implementáciu modelov volatility v softvérových produktoch Mathematica, EViews a R. Súčasťou sú návody na použitie jednotlivých funkcií spolu s popisom vstupov a výstupov zo softvérov v podobe ilustračných príkladov na simulovaných dátach a aplikáciou na reálne dáta.