

Tato bakalářská práce se zabývá modelováním volatility ve financích. Cílem práce je seznámit čtenáře s modely, které se k tomu dají využít. Zaměřujeme se zde na modely GARCH a EGARCH. U obou modelů uvádíme jejich definici a zkoumáme stacionaritu, existenci nepodmíněných momentů a korelační strukturu. Dále přibližujeme GED rozdělení, které se při modelování volatility využívá. V praktické části práce jsou ukázány simulace procesů pro různé volby parametrů, vyšetřována přesnost odhadů parametrů a na závěr je provedena aplikace modelu GARCH a EGARCH na logaritmické výnosy akcií společnosti Apple.