

---

# Finanční ekonometrie

---

# Finance  
# Ekonometrie  
# Riziko  
# Statistická analýza  
# Vysokofrekvenční data

## Co nabízíme

Dokážeme nabídnout metodickou pomoc, poradenství, konzultace, vypracování analýz, a poskytnout školení v oblastech:

- Řízení a měření tržního rizika (Value-at-Risk, dynamické korelační matice)
- Vyhodnocení a řízení kreditního rizika retailových a korporátních klientů
- Kvantitativní analýza finančních dat (oblast finanční ekonometrie)
- Obecná analýza finančních časových řad (metodologie bodových predikcí a predikcí nejistoty)

## Co umíme

Konzultace, poradenství, metodická pomoc, kvantitativní analýzy, školení, zejména v oblastech:

- Pokročilá statistická analýza dat
- Finanční ekonometrie
- Měření rizika
- Vyhodnocení kreditního rizika

## Nedávné publikace

- Zikes, F., Baruník, J. (2015) *Semi-parametric Conditional Quantile Models for Financial Returns and Realized Volatility*, Journal of Financial Econometrics, forthcoming (online first), <http://jfec.oxfordjournals.org/content/early/2014/10/21/jjfinec.nbu029.short?rss=1> .
- Žikeš F., Baruník, J., Shenai N. (2015): *Modeling and Forecasting Persistent Financial Durations*, Econometric Reviews, forthcoming (online first), [http://www.tandfonline.com/doi/full/10.1080/07474938.2014.977057#.VMim7Yf\\_7a4](http://www.tandfonline.com/doi/full/10.1080/07474938.2014.977057#.VMim7Yf_7a4) .
- Franta, M., Baruník, J., Horvath, R., & Smídková, K. (2014): *Are Bayesian Fan Charts Useful? The Effect of Zero Lower Bound and Evaluation of Financial Stability Stress Tests*. International Journal of Central Banking, 10(1), 159–188.
- Baruník, J., Kocenda, E., Vacha, L. (2014): *Volatility Spillovers Across Petroleum Markets*, *The Energy Journal*, forthcoming (online first), <http://www.iaee.org/en/publications/ejarticle.aspx?id=2656> .
- Baruník, J., Kukacka, J. (2014): *Realizing stock market crashes: stochastic cusp catastrophe model of returns under time-varying volatility*, Quantitative Finance, forthcoming (online first), [http://www.tandfonline.com/doi/abs/10.1080/14697688.2014.950319#.VKpwVYf\\_7a4](http://www.tandfonline.com/doi/abs/10.1080/14697688.2014.950319#.VKpwVYf_7a4) .

## Zajímá vás tato expertíza?

**Kontaktujte CPPT UK**

Web: [www.cppt.cuni.cz/](http://www.cppt.cuni.cz/)

Mail: [transfer@cuni.cz](mailto:transfer@cuni.cz)

Tel.: +420 224 491 255

## Naši experti a jejich pracoviště

**PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.**

Fakulta sociálních věd UK

Web: [www.fsv.cuni.cz](http://www.fsv.cuni.cz)