
Obsah

Úvod	7
1 Volatilita časových řad a její modelování	9
1.1 Podmíněná střední hodnota a podmíněný rozptyl	9
1.2 Dvě koncepce řešení problému klasických lineárních modelů	12
2 Transmise a volatilita	25
2.1 Definice měnového transmisního mechanismu ČNB	25
2.2 Ekonometrické vymezení problematiky transmisního mechanismu ...	26
2.3 Vazby v transmisním mechanismu ČR, u kterých má praktický význam sledování přenosu volatility	27
3 Cílené zásahy do vývoje časových řad a volatilita	29
3.1 Analyzované časové řady a jejich modely	29
3.2 Umělé zásahy do průběhu časových řad	35
3.3 Problém přenosu zásahů do průběhu časové řady	37
3.4 Volatilita časových řad a měnová politika	39
Závěr	41
Literatura	43
Příloha	45