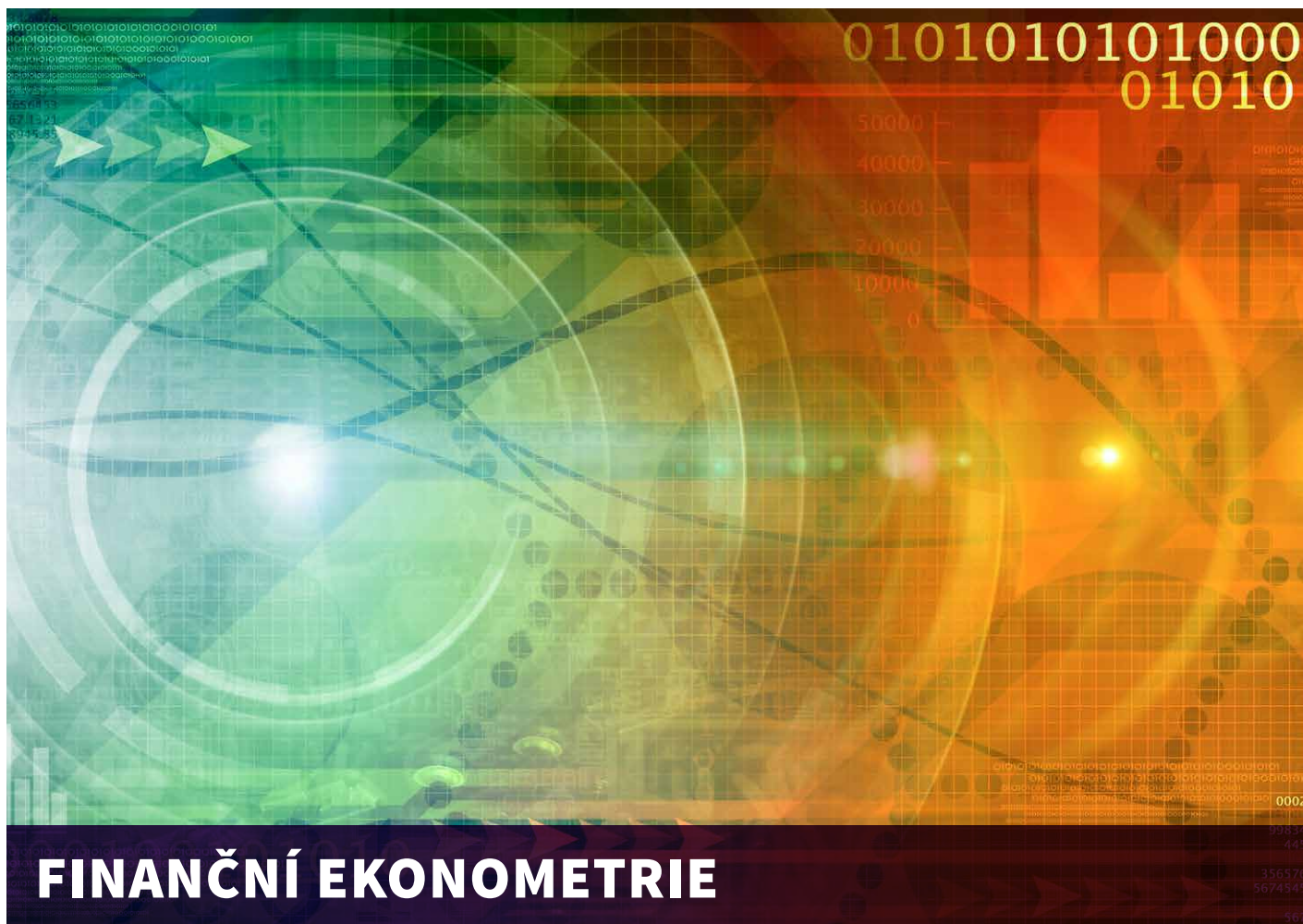




FAKULTA
SOCIÁLNÍCH VĚD
Univerzita Karlova

PhDr. Jozef Baruník, Ph.D.

Opletalova 26
Praha 1, 110 00
+420 776 259 273
jozef.barunik@fsv.cuni.cz



FINANČNÍ EKONOMETRIE

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., Barunik, 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.
- 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.
- Barunik, 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>.
- Barunik, 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.

