

# Finanční Ekonometrie

## Milníky

- **Rané práce (před 1950)**
  - Bachelier (1900) základy stochastického modelování
  - Cowlesova komise (30. - 40. léta) - zavedení rigorózních metod
- **Moderní Era (1950 - 1980) - portfolio, časové řady, odceňování derivátů**
  - Markowitz, Merton, Sharpe **Nobel Prize 1990**
  - Box Jenkins (1970)
  - Merton, Scholes **Nobel Prize 1996**
- **Volatilita a Tržní mikrostruktura (1980 - 1990)**
  - R.Engle a C.Granger **Nobel Prize 2003**
  - E.Fama and L.P.Hansen (obecná metoda GMM) **Nobel Prize 2012**
- **Vysokofrekvenční data a nelineární modely (2000)**
  - Realized volatility

# Finanční Ekonometrie

## Hlavní vývojové trendy

---

- Hlubší integrace teorie a empirických výsledků
  - Společenský dosah - propojení s hospodářskou politikou a regulacemi (kauzální metody)
- 
- Big Data
  - Machine Learning
  - Artificial Intelligence
  - Computer Science
- 

