

Tato práce se zabývá formulací a odhadem mnohorozměrného modelu GARCH. Zmiňuje různé parametrizace mnohorozměrného modelu GARCH a pojednává o vztazích mezi nimi. Představeny jsou nutné a postačující podmínky kovarianční stacionarity mnohorozměrného modelu GARCH a odhad parametrů modelu metodou maximální věrohodnosti. Součástí práce je i odhad parametrů dvourozměrného modelu GARCH(1,1) pro reálné časové řady pomocí EViews.