

Abstrakt

Tato práce zkoumá vliv domácích politických zpráv na Pražskou burzu se zaměřením na segment Prime Market. S využitím panelových i dynamických panelových datových modelů zkoumáme vliv politických zpráv na volatilitu cen akcií. Naše zjištění ukazují, že politické zprávy významně ovlivňují změny cen během obchodních hodin, zatímco na neobchodní hodiny vliv nemají. Pozorujeme také silnou autokorelaci cenových změn. Nebyl zjištěn žádný významný vliv dne v týdnu na změny cen během obchodních hodin. V neobchodních hodinách se však v úterý a v pátek projevují výrazné cenové změny. Tyto výsledky nabízejí cenné poznatky pro investory i pro politiky a zdůrazňují roli politických zpráv na dynamiku trhu.

Klasifikace JEL C33, G12, G14, H79,

Klíčová slova volatilita, burza, dynamická panelová data,
domácí politické zprávy

Název práce Dopad domácích politických zpráv na
Pražskou burzu v letech 2022 a 2023:
Studie tržní aktivity a cenové dynamiky