

V této práci se zabýváme šířením volatility mezi ropou a komoditními potravinami. Základní hypotéza stanovuje ropu jakožto výrobní faktor těchto komoditních potravin a naším cílem je kvantifikování odpovídajících cenových efektů. Využíváme především metod vlnkové koherence a částečné vlnkové koherence, které poskytují hodnotný vhled do onoho spletence komodit, a to bez nutnosti jakýchkoliv přísných omezení a předpokladů, splňovaných našimi daty. Dále aplikujeme DCC-GARCH model, s cílem zachycení předpokládaného šíření volatility. Zároveň jsme provedli i několik jednoduchých analýz k porovnání, jmenovitě jsme otestovali tzv. Grangerovu kauzalitu a spočítali jsme Pearsonův korelační koeficient. Náš vzorek dat, obsahující 10 komodit a dva indexy, pokrývá poslední dekádu, výrazně rozšiřujíc již existující literární kontext. Naše výsledky jsou povětšinou konzistentní se spjatou literaturou, a to především v rámci skupiny ropa-paliva a skupiny zahrnující potraviny. Výsledky v rámci primární otázky našeho výzkumu, zabývajícího se šířením volatility mezi ropou a potravinami, identifikují relativně silný vztah ropy jak se sójou, tak i s kukuřicí. Vztahy ropy s bavlnou a pšenicí respektive, jsou shledány býti komparativně slabší, a spojitosti mezi ropou a skotem jsou prakticky nulové. Hlavní přínosy této práce vychází ze spojení komplexního a aktuálního datasetu s robustním přístupem k celé problematice, ve výsledku poskytující spolehlivé závěry ohledně zkoumaného tématu; tedy notně rozšiřující daný literární kontext.