

V této práci se zabýváme výpočtem ekonomického kapitálu pro celkovou ztrátu vzniklou součtem dílčích závislých ztrát, jejichž závislost je popsána archimédovskými a hierarchickými archimédovskými kopulami. Nejdříve se zavádí pojem ekonomického kapitálu a způsoby jeho agregace. Poté se uvádějí základní definice a vlastnosti kopul, také definujeme míry závislosti. Potom se zabýváme archimédovskými kopulami a jejich simulací, uvádíme také nejrozšířenější rodiny archimédovských kopul. Dále jsou definovány hierarchické archimédovské kopuly spolu s algoritmem na jejich simulaci. Na závěr uvádíme metody odhadu parametrů kopul a rekurzivní algoritmus odhadu struktury hierarchické archimédovské kopuly. V poslední kapitole provádíme simulační studie vybraných modelů s použitím hierarchických archimédovských kopul.