

Táto práca sa zaoberá pokrivenými rizikovými a pomerovými mierami. Ako prvé sú zhrnuté vlastnosti týchto mier vzhľadom k vlastnostiam koherencie a stochastickej dominancii. V práci prezentujeme dôkazy a vysvetľujeme predpoklady na konzistenciu pokrivených rizikových mier so stochastickou dominanciou. Následne ilustrujeme ich vzťah k rizikovým mieram Value-at-Risk a Expected Shortfall, a prezentujeme niekoľko ďalších príkladov týchto mier. Ďalej predstavujeme základy teórie pokrivených pomerových mier. Hlavným teoretickým prínosom tejto práce je predstavenie modelu optimalizácie pokrivených pomerových mier. Tento model predstavujeme s predpokladom diskkrétnej rovnomerne rozdelenej stratovej náhodnej veličiny. V závere práce analyzujeme a diskutujeme výsledky a obmedzenia našej implementácie v špecializovanom optimalizačnom programe GAMS na reálnych finančných dátach. Ako sa ukazuje, skupina pokrivených rizikových mier je perspektívna, pretože nám umožňuje modifikovať pravdepodobnosti v rozdeleniach a umožňuje nám modelovať rôzne úrovne rizikovej averzie.