

Tato práce se zabývá měřením kvality aproximace stochastické dominance. Je zde definována míra nedominance, která kvantifikuje, jak velká chyba vznikne, pokud nesprávně předpokládáme stochastickou dominanci mezi veličinami. Její hodnoty jsou přesně dopočítány pro rovnoměrné, normální a exponenciální rozdělení a pomocí numerické studie jsou odhadnuty některé její hodnoty pro logaritmicko-normální a gamma rozdělení. Dále jsou zde představeny problémy optimalizace portfolia s omezeními ve tvaru stochastické dominance. Tyto problémy jsou pak aplikovány na skutečná data týkající se měsíčních výnosů dvanácti aktiv z německého indexu DAX. V závěru se práce zabývá mírou nedominance pro optimální portfolio vzhledem k druhému řádu stochastické dominance.