

Posouzení extrémních jevů má zásadní význam pro řízení finančních rizik. Všechna riziková manažeri a finanční instituce chtějí znát riziko svého portfolia. Použijte metodu Monte Carlo a semi-parametrickou metody pro odhad Value-at-Risk (VaR) pro portfolio indexů burz ve střední Evropě.