

V předložené práci studujeme jednotlivá rizika, kterým podnik je neustále vystaven. Zaobíráme se ohodnocením rizik z různých pohledů, největší důraz je však kladen na nejmodernější typ míry rizik: Value at Risk. Studujeme různé možnosti, jak tuto hodnotu odhadnout na základě historických dat. V další části se zaobíráme nejdůležitějšími typy rizik, a to tržním rizikem, rizikem likvidity, kreditním rizikem a riziky operačními. Pro ilustraci a usnadnění výpočtů je práce provázena ukázkovými příklady a procedurou naprogramovanou v systému Mathematica.