

Název práce: Optimalizace a zátěžové testy

Autor: Diana Fašungová

Katedra: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí diplomové práce: Prof. RNDr. Jitka Dupačová, DrSc., Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Abstrakt: V práci aplikujeme techniku kontaminačních mezí na úlohu optimalizace portfolia akcií při rizikové míře CVaR. Úlohu uvažujeme z pohledu rizikového manažera. Používáme vhodně zvolená data a dva typy zátěžových scénářů generovaných za účelem stresování korelační struktury dat a výnosu jednotlivých akcií. Z numerické aplikace vyvozujeme na základě chování rizikové míry CVaR vzhledem ke kontaminačnímmezím doporučení pro řízení rizik pro úlohu optimalizace portfolia. Tato doporučení interpretujeme pro oba typy scénářů. Na závěr diskutujeme omezení zvoleného modelu a možnosti dalšího vylepšení.

Klíčová slova: kontaminační meze, zátěžové testy, optimalizace portfolia, řízení rizik