

## Abstrakt

V této práci analyzujeme systematické riziko bank v rámci Visegrádské čtyřky (V4). Obzvláště se pak zaměřujeme na vztah mezi pobočkou v dané zemi Visegrádské čtyřky a její zahraniční mateřskou společností, který následně porovnááme se vztahem mezi lokálními pobočkami. Docházíme k závěru, že systematické riziko mezi pobočkami v rámci jedné země V4 je vyšší než mezi matkou a její pobočkou. Naše analýza je založena na metodě, které vychází z neparametrické vícedimenzionální teorie extrémních hodnot, která není spjata s konkrétním rozdělením; tudíž jsou naše výsledky robustní vzhledem k těžkým chvostům.

**Klíčová slova**

Teorie extrémních hodnot, systematické riziko, finanční stabilita, Vysegrádská čtyřka, vztah pobočky a mateřské společnosti

**E-mail autora**

`tomas.fiala@gjn.cz`

**E-mail vedoucího práce**

`boril.sopov@gmail.com`