

Název práce: Stabilní rozdělení a finanční aplikace
Autor: Vadym Omelchenko
pravděpodobnosti a matematické statistiky
Vedoucí diplomové práce: Prof. Lev Klebanov, DrSc.
e-mail vedoucího: Lev.Klebanov@mff.cuni.cz

Abstrakt: Tato práce se zabývá teorií stabilních rozdělení, metodami odhadu jejich parametrů a jejich finanční aplikací. Byly zmíněny všeobecně známé odhady a navrženy metody odhadu parametrů na základě charakteristické funkce a projekční metody, která je modifikací metody maximální věrohodnosti. Kvalita odhadů se zjišťovala s pomocí simulací náhodného výběru ze stabilního rozdělení se známými parametry a porovnání odhadů parametrů s jejich skutečnými hodnotami. Jádrem této práce jsou odhady parametrů stabilních rozdělení, což je aplikovatelné pro modifikace modelu typu ARCH/GARCH se stabilní inovací.

Klíčová slova: stabilní rozdělení, ARCH/GARCH modely, odhady založené na charakteristické funkci (CF), odhady založené na projekční metodě, příbuzné odhadům ML (MLP).