

Hlavním cílem této práce je pojednat o rizikových mírách, které se využívají ve financích a pojišřovnictví. Tato práce je zaměřena na popis jejich matematických vlastností a jejich vzájemných vztahů. V této práci jsou vyloženy koherentní rizikové míry, spektrální rizikové míry a pokrřivené rizikové míry. Velká pozornost je také věnována hodnotě v riziku, která do jisté míry prostupuje všemi výše zmíněnými rizikovými mírami. Pozornost je také soustředěna na použití uvedených rizikových měř na ilustrativních případech, které objasňují uvedené vlastnosti. Dále jsou demonšřovány uvedené míry na kvantifikování rizika portfolia vycházejícího z reálných dat.