

Abstrakt

V této práci zkoumáme míry rizika a jednu z jejich vlastností - koherenci. Zaměřujeme se zejména na hodnotu v riziku (zkráceně VaR), respektive na podmíněnou hodnotu v riziku (CVaR). Zmiňujeme také výhody CVaR oproti VaR. Dále rozebíráme nejběžnější formy složeného rozdělení, které jsou užívány v praxi. Závěrečná část této bakalářské práce je věnována numerické studii, kde počítáme střední hodnotu, rozptyl, VaR a CVaR pro konkrétní hodnoty parametrů.