

Abstrakt: Práca sa zaoberá robustnými metódami v teórii portfólia. Sú popísané rôzne miery rizika, ktoré sa využívajú pri optimalizácii portfólia, a na základe popísaných mier sú sformulované odpovedajúce optimalizačné úlohy. Analytické riešenie problému robustnej optimalizácie portfólia je uvedené pre miery rizika lower partial moments (LPM), value-at-risk (VaR) a conditional value-at-risk (CVaR). Práca popisuje aplikácie worst-case conditional value-at-risk (WCVaR) v oblasti finančného manažmentu, pričom sú detailnejšie skúmané a popísané minimalizačné úlohy za predpokladu zmiešaného rozdelenia, „box“ neistoty a „ellipsoidal“ neistoty. V závere práce sú prezentované výsledky numerickej štúdie na reálnych dátach z finančného trhu.