

Tato diplomová práce se zabývá teorií extrémních hodnot a její aplikaci ve finančním rizikovém manažmentu s hlavním zaměřením na výpočet známé rizikové míry - hodnoty v riziku (VaR). V první, teoretické části, je poskytnut důkladný průřez teorií extrémních hodnot s důrazem na její fundamenty, jejich důsledky a shrnutí metod založených na této teorii. Konkrétněji jsou studovány: metoda blokových maxim, Hillova metoda a metoda založená na překročení meze. Dále jsou zdůrazněny statistické problémy, které při aplikaci těchto metod mohou vzniknout a to, jak se s nimi vypořádat. Druhou část tvoří rozsáhlá empirická studie, v níž se uvedené statistické postupy aplikují na reálná tržní data cen akciového indexu Dow Jones Industrial Average, akcií americké banky JPMorgan a akciového indexu Russell 2000, a to primárně za účelem obecnějšího porovnání počínání jednotlivých metod založených na teorii extrémních hodnot společně s dnes již tradiční metodologií RiskMetrics.