Obsah

1. Podnikové řízení rizik 5
2. Míry rizika
   - 2.1 Základy teorie měr rizika 6
   - 2.2 Procesové a parametrové riziko 12
   - 2.3 Parametrové riziko v multiplikativním modelu vývoje škod 14
3. Modelování a měření závislostí
   - 3.1 Úvod do teorie kopul 18
   - 3.2 Příklady kopul 22
   - 3.3 Simulační techniky 25
   - 3.4 Identifikace kopuly z dat 27
   - 3.5 Perfektní závislost 34
   - 3.6 Lineární korelace 35
   - 3.7 Pořadové korelace 38
   - 3.8 Koncová závislost 44
4. Riziko extrémních hodnot
   - 4.1 Parametrické modely extrémních hodnot 49
   - 4.2 Analýza dat v modelech extrémních hodnot 57
5. Agregace rizik
   - 5.1 Agregace součtem 66
   - 5.2 Agregace pomocí korelační matice 68
   - 5.3 Agregace pomocí kopul 75
   - 5.4 Porovnávání rizik 75
   - 5.5 Meze podle konvexního uspořádání 76
   - 5.6 Meze podle stochastického uspořádání 81
6. Riziko dlouhověkosti v životním pojištění
   - 6.1 Modelování vývoje úmrtnosti v čase 90
   - 6.2 Kvantifikace rizika dlouhověkosti 98
   - 6.3 Řízení rizika dlouhověkosti 101
7. Kreditní riziko
   - 7.1 Model CreditRisk+ 106
   - 7.2 Model KMV 110
   - 7.3 Kreditní migrace - model CreditMetrics™ 113