

Projekt – zadanie 2

Termin prezentacji: 16.04.2024, 17.04.2024

Wyznacz miary ryzyka dla dwóch wybranych zmiennych ryzyka (np.: cen surowców, cen akcji, cen produktów, zysku, kursu walut, popytu, itp.).

1. W przypadku jednowymiarowym
 - a. Miara/y zmienności
 - b. Kwantyle
 - c. Wartości dystrybuanty
 - d. (*) Miary wrażliwości
2. W przypadku wielowymiarowym dla tych samych zmiennych co w pkt.1
 - a. Miara/y zmienności dla portfela
 - b. Kwantyle dla portfela
 - c. Wartości dystrybuanty dla portfela i dystrybuanty 2-wymiarowej
 - d. Porównaj z wynikami z pkt 1
3. Dla ryzyka ekstremalnego (dla przynajmniej 1 zmiennej ryzyka):
 - a. Dopasuj rozkład graniczny maksimów lub warunkowych przekroczeń
4. Przeprowadź testowanie wsteczne dla dwóch wybranych przypadków z punktów 1-3
5. ZINTERPRETUJ OTRZYMANE WYNIKI