

Projekt – zadanie 3

Termin prezentacji/oddania: 14/15.05.2024

Dla strat/zwrotów (lub stóp strat/zwrotów) z wybranej zmiennej ryzyka:

1. Oblicz $\text{VaR}_{95\%}$ i $\text{VaR}_{99\%}$
 - a. metodą parametryczną z wybranym rozkładem
 - b. metodą historyczną
 - i. zwykłą
 - ii. ważoną
 - iii. przy użyciu filtrowania szeregiem GARCH
 - c. metodą Monte Carlo z wybranym rozkładem/procesem
2. Przeprowadź testowanie wsteczne wybraną metodą dla 1a), 1b), 1c). Porównaj wyniki.
3. (zadanie dodatkowe) Wykonaj zadania z punktów 1-2 dla ekspektywnej wartości zagrożonej (EVaR).