

## Projekt – zadanie 2

Termin prezentacji: 18.04.2023

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