

Cieľ: Cieľom predmetu je oboznámiť študentov s vybranými metódami určenými na analýzu a riadenie finančných rizík dostupnými v analytickom nástroji SAS® RISK Dimensions®.

- 1.týždeň:** SAS® RISK Dimensions® – nástroj na analýzu rizík. Úvod do systému. GUI. Vytvorenie pracovného prostredia, definícia premenných, definícia nástrojov portfólia, reporty, analýzy, vytvorenie projektu.
- 2.týždeň:** Úvodná analýza. Vytvorenie pracovného prostredia pomocou GUI. Deklarovanie finančných inštrumentov, vytvorenie rizikových premenných, registrovanie trhových údajov, vytvorenie jednoduchých analýz.
- 3.týždeň:** Úvodná analýza. Vytvorenie pracovného prostredia pomocou procedúr SAS® RISK Dimensions®. Deklarovanie finančných inštrumentov, vytvorenie rizikových premenných, registrovanie trhových údajov, vytvorenie jednoduchých analýz.
- 4.týždeň:** Analýza rizika štátnych pokladničných poukážok. Analýza citlivosti, delta-normálne analýzy pre odhad VaR.
- 5.týždeň:** Príprava a analýza historických údajov pre simulačné analýzy pre odhad VaR.
- 6.týždeň:** Analýza rizika štátnych pokladničných poukážok Simulačné analýzy pre odhad VaR (metóda historickej simulácie, simulácie Monte Carlo).
- 7.týždeň:** Analýza rizika kupónových dlhopisov. Analýza citlivosti, delta-normálne analýzy pre odhad VaR.
- 8.týždeň:** Analýza rizika kupónových dlhopisov. Simulačné analýzy pre odhad VaR (metóda historickej simulácie, simulácie Monte Carlo).
- 9.týždeň:** Analýza rizika opcií. Analýza citlivosti, delta-normálne analýzy pre odhad VaR.
- 10.týždeň:** Analýza rizika opcií. Simulačné analýzy pre odhad VaR (metóda historickej simulácie, simulácie Monte Carlo).
- 11.týždeň:** Optimalizácia portfólia
- 12.týždeň:** Backtesting VaR
- 13.týždeň:** Vytváranie reportov v SAS® RISK Dimensions®
- 14.týždeň:** Samostatná práca na projekte