

O B S A H

	strana
1. ANALÝZA RIZIKA (AR) A ROLE METODY MONTE CARLO V AR	6
1.1 Historie analýzy rizika	6
1.2 Různá pojetí rizika, jeho chápání a definice, klasifikace rizikových situací	6
1.3 Měření rizika	7
1.4 Softwarové komerčně dodávané systémy pro analýzu resp. management rizika	7
1.5 Teorie versus praxe metody Monte Carlo	7
1.6 Cíle praktických aplikací	8
2. PRINCIP METODY MONTE CARLO	9
2.1 Ilustrační příklady aplikace metody Monte Carlo	9
2.1.1 Aplikace metody Monte Carlo na modelování deterministického systému	9
2.1.2 Aplikace metody Monte Carlo na modelování stochastického systému	12
2.2 Sestavení deterministického matematického modelu	13
2.3 Sestavení stochastického matematického modelu	16
2.4 Výpočty s využitím simulace metodou Monte Carlo	17
2.5 Stručný popis metody Monte Carlo	17
2.6 Náhodná čísla a jejich generování	18
2.7 Generování hodnot náhodných veličin s daným rozdělením	19
3. APLIKACE METODY MONTE CARLO	
3.1 Aplikace č. 1: Simulační model pro výpočet <i>NPV</i>	20
3.2 Aplikace č. 2: Simulační model pro výpočet hospodářského výsledku podniku (HVP)	25
4. ZÁVĚR	30
LITERATURA	31
doc. RNDr. Ing. Jaroslav Klvaňa, CSc	33