

Tato diplomová práce pojednává o strukturovaných produktech, které se nazývají dluhopisy zajištěné aktivy (CDO). Popisuje mechanismy, na jejichž základě tyto struktury fungují, metody oceňování, při nichž je využíváno tzv. kopulí a řeší problematiku volby podkladového portfolia, která významně ovlivňuje výstupy kvantitativních analýz těchto produktů. Na závěr jsou tyto metody a výstupy kvantitativních analýz aplikovány na fiktivní podkladové portfolio.