

Tato bakalářská práce se zaměřuje na studium expektilů jako alternativního přístupu k tradičním kvantilům. Expektily se stávají stále populárnějšími jako míra rizika v různých oblastech, včetně finančního a pojišťovacího sektoru. V práci jsou uvedeny základní vlastnosti a jednotlivá odvození jsou podrobně popsána. V rámci odhadu expektilu je vedle definice výběrového expektilu představena parametrická metoda odhadu expektilu. Praktická část je věnována odhadům výběrového expektilu, parametrického odhadu momentovou metodou a porovnáním obou metod na nasimulovaném výběru z exponenciálního rozdělení.