

V tejto diplomovej práci sme sa pokúsili modelovať likviditné riziko s pomocou kopulových funkcií. Prezentovali sme teoretické pozadie pre obe oblasti, teóriu kopúl a likviditné riziko. Empirická časť sa zameriava viac na likviditu v štátoch strednej a východnej Európy a hlavne na Slovensku a Českej republike. V tejto časti sme vytvorili trhový likviditný index pre slovenský finančný trh a analyzovali dopad likviditných problémov počas finančnej krízy na celkovú likviditu na tomto trhu. Ďalej sme modelovali možnosť nákazy trhu rizikom likvidity v českom bankovom sektore, na základe ukazovateľa celkových úverov k celkovým vkladom Komerčnej banky, Českej sporitelne a GE Money Bank.