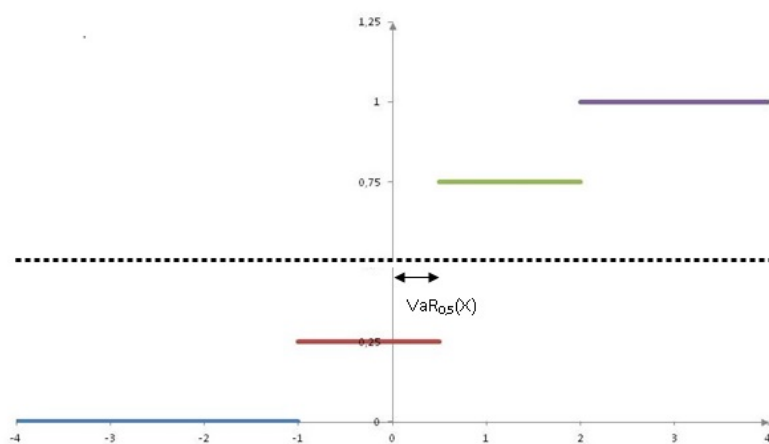


Rys. 2.7: Dystrybuanta pozycji finansowej X_1

Źródło: opracowanie własne



Rys. 2.8: Dystrybuanta zdywersyfikowanej pozycji X

Źródło: opracowanie własne

2. Największą wadą związaną z VaR jest słaba ocena ryzyka. Wiąże się to z tym, że pewne straty mogą być dużo większe aniżeli