

Posudek na diplomové práci Róberta Chovaneca  
„Zobecněný stabilní model ve financích“

Autor se študuje problém aplikace stabilních rozdělání. Uvedeny definicí, vlastnosti a metody simulace stabilních rozdělání. Velká část prací je věnovaná popisu modelu ARMA, GARCH a jejich modifikaci pro stabilní rozdělání a odhadu parametru modelu. Empirická část této práce je založená na porovnání mezi modelem, zavedenými v teoretický části, pod normálním a stabilním rozděláním. Výsledky statistického analýzu ukazují, že modely založené na stabilním rozdělání schvalují se lepše s empirickým rozděláním než modely založené na Gaussovom rozdělání.

Myslím že diplomová práce je dodržena kvalitně a samostatné, a její autor zaslouží titulu magistru.

Vedoucí, Dr. Sc., Profesor Lev Klebanov.

