

## Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Radka Picková

Název práce: Odhady Value at Risk, nestandardní postupy

Jméno vedoucího/oponenta: Martin Šmíd

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace citované z literatury opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji

uznat jako diplomovou. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Úroveň je vysoce nad standardem diplomové práce, text je pečlivě napsán, angličtina je dobrá. Přínos pro praxi spočívá v popisu a aplikaci metod odhadu VaR v ne-i.i.d. modelech výnosů, přínosem pro teorii je „vyčištění“ důkazu konzistence odhadu parametrů CAViAR modelů (věta 1), který je ve zdrojovém článku téměř pomínut. Vážnější připomínku mám jedinou: u důkazu věty 1. není jasně uvedeno, co přesně je autorčíným příspěvkem a co je převzato (skutečný stav věci, uvedený výše, jsem musel zjistit osobním dotazem). Tato připomínka ovšem nic nemění na mém vysoce kladném hodnocení.

Místo, datum, podpis vedoucího/oponenta:

22.4.08

