

Posudek

vedoucího oponenta
diplomové bakalářské práce
Autor/Autorka: Patrik Hudec
Název práce: Výpočet historické volatility FX-opcí
Jméno vedoucího/oponenta: Jan Hurt

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/bakalářskou. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Přípomínky a vyjádření vedoucího/oponenta: Na str. 13 má místo Lambda být Delta. Co se míní zobecněným Wienerovým procesem na str. 16? Na str. 17 a jinde chybí odkazy na literaturu, ze které autor čerpal, viz např. (3. 17a). Co znamená porucha grafu na str. 20?

Místo, datum, podpis vedoucího/oponenta: Praha 18. září 2008

Symbol získáte tak, že vedle symbolu stisknete klávesu 7 (při nastavené české klávesnici), symbol pak smažete.