

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Patrik Hudec

Název práce: Výpočet historické volatility FX - opcí

Jméno vedoucího/oponenta: Jan Strakoš

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

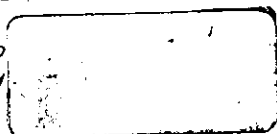
uznat jako diplomovou. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Přípomínky a vyjádření vedoucího/oponenta:

Autor se odvážně pustil do originálního řešení praktického problému výpočtu historické volatility. Výsledkem jeho práce je model jehož aplikace poskytuje komplexnější obraz než klasický výpočet. Rozsah tématu však není možno plně pokrýt v rámci jedné diplomové práce a tak zůstávají některé aspekty dané problematiky pouze naznačeny a zasluhovaly by si větší pozornost. Můžeme jen doufat, že se autor k problému vrátí. Potenciál na to rozhodně má.

Místo, datum, podpis vedoucího:

PRAHA, 10.9.08,



Název diplomové práce: Výpočet historické volatility FX -- opcí

Autor: Patrik Hudec

Vedoucí práce: Jan Strakoš

Návrh klasifikace: Navrhuji ohodnotit diplomovou práci známkou výborně

Místo, datum, podpis vedoucího:

PRAHA, 10. 9. 08

