

Posudek

vedoucího
vedoucího oponenta
diplomové bakalářské práce

Autor: Michal Bošela

Název práce: Modelování kreditního rizika

Jméno vedoucího/oponenta: Imrich Lozsi

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:

Ucelený přehled jak tradičních, tak i poměrně nových modelů kreditního rizika, pracujících s neúplnými informacemi. Práce byla vypracována zcela samostatně. V některých pasážích je až příliš zřejmá vazba na zdrojovou literaturu, což je patrně důsledkem skutečnosti, že se jedná spíše o kompilační práci, než o praktickou aplikaci. Ke zvýšení její úrovně by přispělo, pokud by se diskutované modely aplikovali na konkrétní data. Práce obsahuje některé nepřesné formulace („defaultable bond“ není kreditní derivát), či překlepy.

Místo, datum, podpis vedoucího/oponenta: Praha, 22. května 2009

IMRICH LOZSI