

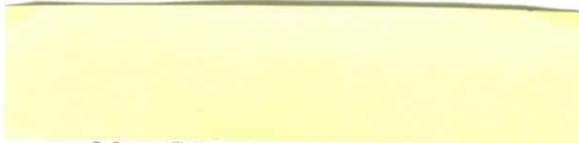
Posudek vedoucího

Název bakalářské práce: Modely volatility ARCH a GARCH
Jméno autora: Martin Jusko
Jméno vedoucího: Mgr. Šárka Došlá

Martin Jusko se ve své práci zabývá modely volatility ARCH a GARCH. Popisuje jejich základní vlastnosti, metody odhadu a možnosti využití. Následně je názorně předvedeno, jakým způsobem lze tyto modely aplikovat v programu R. Významnou součástí předložené práce jsou podrobně popsané aplikace představených modelů na konkrétní datové soubory. Jsou analyzovány časové řady zachycující vývoj pražského burzovního indexu PX a směnného kurzu české koruny vůči euru. Pomocí nasimulovaných dat jsou dále ilustrovány některé související teoretické vlastnosti. V těchto praktických částech práce (kapitola 4) shledávám jednoznačný vlastní přínos studenta.

Martin Jusko pracoval velice samostatně. Dokázal dobře pochopit a následně srozumitelnou formou představit studované modely časových řad. Prokázal, že se v dané problematice orientuje nejen po teoretické, ale také po praktické stránce. Zejména bych ráda poukázala na jeho zručnost při práci se softwarem (programem R). Grafická, jazyková a formální úroveň práce je velmi dobrá. V práci je možné nalézt několik drobnějších nepřesností či tiskových chyb, které však výrazněji nenarušují celkový dobrý dojem.

Předloženou práci Martina Juska považuji za velmi kvalitně zpracovanou a doporučuji ji uznat jako bakalářskou.



Mgr. Šárka Došlá
KPMS MFF UK
V Praze dne 15. června 2009