

## Posudek

vedoucího  oponenta

diplomové  bakalářské práce

Autor/Autorka: Michal Opl

Název práce: Oceňování opcí pomocí rychlé Fourierovy transformace

Jméno vedoucího/opponenta: 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  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.

### Připomínky a vyjádření vedoucího/opponenta:

Celkový přístup k řešení problému mi připadá archaický. Při použití moderního počítačového systému (viz Mathematica) by se asi výpočty obešly bez FFT. Nejdříve by se symbolicky vypočetly výplatní funkce a ty by pak dále byly numericky zpracovány (pravděpodobně pomocí vnitřně zabudované FFT). Velmi neúplné citace. Světovost libovolné presentace není možné dosahovat pokleslou směsí češtiny a angličtiny (strike má po mnoho desetiletí český ekvivalent realizační cena, vyskytuje se i jinde). Nedbalé zpracování: str. 19 proces  $X(t)$ , o řádek níže čas jako index, na str. 22 „statistický proces“ místo stochastický.

Místo, datum, podpis vedoucího/opponenta: Praha, 4. června

Symbol  získáte tak, že vpravo vedle symbolu  stisknete klávesu x, symbol