

Posudek oponentky na bakalářskou práci

Petra Strejce

SHLUKOVÁ ANALÝZA VE FINANCÍCH

Obsahem práce je aplikace vybraných metod mnohorozměrné statistiky na finanční data včetně výkladu teorie shlukové analýzy. Jedná se o látku, která není součástí učebních plánů bakalářského studia finanční matematiky. Posлуhač zpracoval zadanou problematiku přehledně a srozumitelně, text je kvalitní po jazykové a grafické stránce, odborná náročnost tématu je průměrná.

Mám následující drobné připomínky a dotazy:

Str. 7: nevhodné pojmenování n -rozměrný vektor znaků (matice), lépe matice p -krát n znaků měřených na n objektech, n a p jako rozměry vektorů a matic doporučuji psát kurzívou.

Str. 9-10: pro kvalitativní znaky, které lze resp. nelze uspořádat, se někdy používají termíny ordinální a nominální proměnné.

Str. 19, text za vzorcem (5.1): $C_j \dots j$ má být v indexu.

Str. 19, vzorec $t_i = \min_{t \in C_j} \sum_{X_i \in C_j} d(X_i, t_j)$... nevhodné použití t_i na levé a pravé straně rovnice, doporučuji doplnit index iterace algoritmu.

Str. 18, str. 23: jak se lze na základě dendrogramu rozhodnout, kdy ukončit hierarchický shlukovací algoritmus ?

Str. 22: lze pro výběr finančních ukazatelů z větší množiny před provedením shlukové analýzy použít nějakou jinou metodu mnohorozměrné statistiky ?

Str. 26: nabízí program Mathematica pro identifikaci odlehlých objektů a zjištění jejich odlišnosti v jednotlivých znacích například grafy průmětů objektů do dvojic měřených znaků ?

Závěrem konstatuji, že jsem v práci neshledala závažné chyby a nedostatky, a doporučuji její uznání jako práce bakalářské.

V Praze 25.8. 2009

RNDr. Jitka Zichová, Dr.