

Posudek oponentky na bakalářskou práci

Adama Kubetty

## SIMULACE VE FINANCÍCH

Práce podává přehled různých simulačních metod, které lze využít ve finanční analýze. Teoretická část výrazně převažuje nad částí aplikační. Hlavním přínosem je implementace simulačních procedur v programu Mathematica. Výpisy z programu ilustrují popis jednotlivých postupů v teoretické části, jejich pochopení vyžaduje znalost programování v Mathematice.

Předložený text přesahuje běžný rozsah bakalářských prací a věnuje se tématu, které není vyučováno v bakalářském ani následujícím magisterském studiu oboru Finanční matematika. Jeho odbornou úroveň hodnotím jako velmi dobrou.

Styl psaní se místy blíží popularizačnímu článku spíše než odbornému pojednání – např.  
str. 8 – ... neodbočujme ale od tématu..., ...vraťme se proto opět na chvíli k teorií...,  
str. 9 – ...zkrátka na vstupy, které Mathematica analyticky upočítá...,  
...nepříjemný výstup..., zbytečně spoustu času...,

str. 39 – ... už snad ani nemůže být řeč o náhodnosti ...

Text také obsahuje nezanedbatelný počet překlepů a drobných gramatických chyb a některé nevhodné formulace

(str. 2 – ... by byla pravděpodobnost takového jevu skoro jistě 0...)

Za závažný formální nedostatek považuji opakované používání špatného názvu kongurenční namísto kongruenční generátory.

Dále mám následující dotazy a připomínky:

str. 13 – ... vektor středních hodnot jsem ponechal v obecném tvaru, aby vynikla znaménka korelací mezi složkami...

Na kterém místě jsou vidět korelace ?

str. 33 – ve třetím řádku úprav výrazu  $\text{var } \hat{I}_n$  by měla být suma rozptylů,

str. 47 – co je míněno pojmem nějaké rozumné portfolio ?

Přes uvedené výhrady konstatuji, že posluchač zvládl přidělené téma a práci lze uznat jako bakalářskou.

V Praze 25.8. 2009



RNDr. Jitka Zichová, Dr.