

## Posudek oponentky na diplomovou práci

Slavky Ďurišové

MIERY RIZIKA

Práce je věnována různým typům rizika a metodám jeho měření. Jedná se o kompilaci z různých zdrojů. Po teoretické části textu následuje numerická studie, která je samostatným přínosem autorky. Výpočty se týkají vývoje jistého cenového indexu a jsou zaměřené na určení hodnoty v riziku (VaR). Použit byl MS Excel.

Práce je psána ve slovenském jazyce, pečlivě a srozumitelně. Diplomantka prokázala schopnost nastudovat určitý objem literatury a získané poznatky prakticky aplikovat.

K textu mám následující připomínky:

str. 17, vzorec (3.1.22): mělo by být  $A^j$  místo  $P^j$ ,

str. 26, ř. 10 odshora: mělo by být  $r_{it}$  místo  $r_{iT}$ ,

str. 33, vzorec (4.2.2): mělo by být  $F_Y(x)$  místo  $F_Y(y)$ ,

str. 37, ř. 3 odspodu: proč nejsou zmíněné histogramy (5.4), (5.5), (5.6) hned na následujícím listu?

str. 38, ř. 3 odspodu:  $u(\alpha)$  je kritická hodnota  $N(0,1)$  na hladině  $\alpha$ , tedy  $1-\alpha$  kvantil, nikoli  $\alpha$  kvantil,

Uvedené drobné nepřesnosti nikterak nesnižují kvalitu práce, kterou doporučuji přijmout k obhajobě.

V Praze 16.5.2006

RNDr. Jitka Zichová, Dr.