

Posudek

vedoucího oponenta
diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Martina Jírů

Název práce: Nelineární analýza časových řad a její aplikace ve financích

Jméno oponenta: Prof. RNDr. Tomáš Cipra, DrSc.

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální 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. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření oponenta:

Diplomová práce je zajímavou ukázkou možností současné nelineární analýzy časových řad.

Připomínky:

- chybí diskuse odhadových výsledků (např. pro simulace ARCH, GARCH, SETAR)
- není uveden simulační příklad pro model CHARN (nejméně známý z nelin. modelů)
- v řadě případů není uvedeno, jakými softwarovými nástroji byly odhady či testy provedeny (je zmíněn pouze XploRe)

Místo, datum, podpis oponenta: Praha, 2.5.2006

