

Posudek vedoucí na bakalářskou práci

J a n y V a v e r o v é

V Í C E R O V N I C O V É S O U S T A V Y  
J A K O N Á S T R O J P R O Z P R A C O V Á N Í  
F I N A N Č N Í C H A E K O N O M I C K Ý C H D A T

Data z oblasti ekonomie a financí mají často podobu záznamů několika proměnných, které se navzájem mohou ovlivňovat, v čase. Takováto data lze modelovat pomocí víceroznicových ekonometrických soustav. Cílem práce bylo seznámení posluchačky s danou problematikou a aplikace na reálných datech. Za speciální případ víceroznicových soustav lze považovat mnohorozměrné autoregresní modely časových řad, které jsou v práci rovněž teoreticky i prakticky pojednány. Je třeba zdůraznit, že vše, co je v textu práce, bylo pro posluchačku novou látkou neobsaženou v učebních plánech bakalářského oboru Finanční matematika.

Autorka pracovala zcela samostatně a se zájmem o zvolené téma. Prokázala schopnost nastudovat netriviální teoretické partie a s použitím programu Mathematica analyzovat data. Výsledkem je kvalitní kompilace s názornými numerickými ilustracemi. Její matematickou úroveň hodnotím jako velmi dobrou, uspokojivé je i grafické a jazykové zpracování. Předložený text považuji za přínosný pro finanční praxi, neboť ukazuje metody, které nejsou natolik používané jako například lineární regrese nebo jednorozměrné modely časových řad. Práci doporučuji uznat jako bakalářskou.

V Praze 10.8.2011

RNDr. Jitka Zichová, Dr.