

Posudek oponentky na bakalářskou práci

Jakuba Mertla

SIMULAČNÍ MODELY ÚROKOVÝCH MĚR

Práce je věnována Vašíčkovu modelu pro popis chování úrokových měr v čase, a to zejména jeho diskretní podobě. Posлуhač nastudoval problematiku modelu a srozumitelně jej popsal. K praktické aplikaci na reálná data použil software Mathematica 5.2, v textu jsou vysvětleny funkce a příkazy používané v simulační studii. Výsledky simulační studie jsou přehledně shrnuty a doprovázejí je četné názorné grafy. Text je napsán pečlivě, bez tiskových a věcných chyb. Mám k němu pouze následující dotazy:

str. 15, ř. 12 odspodu: „... rozhodnout, zda jsou regresní koeficienty odhadnuty dobře či špatně.“ ... v jakém smyslu?

str. 15, ř. 10 odspodu: čeho se týká F-test v analýze rozptylu?

Autor práce prokázal schopnost seznámit se s teoretickou stránkou zadaného tématu a s použitím vhodného softwaru provést modelování na základě dat z finanční praxe. Práce je zajímavou ukázkou možností zpracování časových řad úrokových měr. Doporučuji její přijetí k obhajobě.

V Praze 6.6.2006



RNDr. Jitka Zichová, Dr.