

Posudek vedoucí na diplomovou práci

Matúše Baniara

E K O N O M E T R I C K Á A N A L Ý Z A F I N A N Č N Í C H D A T

Cílem práce bylo seznámení posluchače s vybranými přístupy pro modelování finančních dat spadajícími do oblasti ekonometrie a analýzy mnohorozměrných časových řad, a to po teoretické i praktické stránce. Toto zadání bylo splněno, posluchač přistoupil k problematice se zájmem a iniciativou a rozšířil si znalosti získané v povinných předmětech oboru Finanční a pojistná matematika.

Teoretická část čerpá ze základní literatury a rozšiřující literatury samostatně vyhledané diplomantem. Je sepsána kultivovaným odborným stylem, matematická úroveň je na patřičné výši. Autor oproti literatuře podrobně rozepsal maticové tvary studovaných modelů a samostatně navrhl ilustrační příklady. Hlavním individuálním přínosem je praktická část, v níž jsou popsány přístupy demonstrovány na reálných datech s použitím softwarového systému Mathematica, přičemž je stručně pojednáno i o jiných softwarových možnostech. Text je doplněn názornými grafy a tabulkami. O vysoké kvalitě aplikační části práce svědčí skutečnost, že programové řešení pro konstrukci modelu vektorové autoregrese prošlo recenzním řízením a bylo zveřejněno na webových stránkách Wolfram Demonstrations Project.

V práci se nevyskytují zásadní věcné ani tiskové chyby, jazykovou i grafickou úroveň lze hodnotit jako vynikající. Doporučuji proto, aby byla přijata jako práce diplomová.

V Praze 19.5. 2014

RNDr. Jitka Zichová, Dr.