

Errata diplomové práce

Kvantitativní metody řízení rizika

- Str. 5: V definici 1.3 chybí předpoklad o platnosti $\text{var}(X_t) < \infty$ pro všechna t .
Brockwell P.J., Davis R.A. (1991): Time Series: Theory and Methods. (2nd ed.)
Springer, New York.
- Str. 8: V definici 1.12 chybí předpoklad o platnosti $E X_{ti}^2 < \infty$ pro všechna t
a všechna i .
Brockwell P.J., Davis R.A. (1991): Time Series: Theory and Methods. (2nd ed.)
Springer, New York.
- Str. 9: Operátor $\text{diag}\{\mathbf{A}\}$ transformuje matici \mathbf{A} na matici diagonální zachování prvků na diagonále.
- Str. 24: V definici 3.3 chybí, že $\Sigma_t^{1/2} \in \mathbb{R}^{d \times d}$ je Choleského faktor pozitivně semidefinitní matice Σ_t .
- Str. 30: Postup odhadu DCC modelu je možné shlédnout v práci:
Engle R. F. (2002): Dynamic conditional correlation—a simple class of multivariate GARCH models. *Journal of Business and Economic Statistics* **20**, 339–350.
- Str. 43 a 44: Je uvedena chybná hodnota korelačního koeficientu 0,512. Správná hodnota je 0,4435.

V Praze dne 14.9.2014

Daniel Marcinek