

Spojité procesy s kvadratickou variací

Předložená práce poskytuje teorii potřebnou pro odvození Itôovy formule a následně i Black-Scholesovy formule pro nutné počáteční bohatství, ze kterého je možné bezpečně replikovat evropskou kupní opci.

Student projevoval značnou chápavost studované látky, která se ovšem velmi obtížně projevila při sepisování práce. Ne úplně šťastný byl také časový zvolený management, který se projevil v tom, že některé části práce zůstaly nedočesané. Tentýž důvod byl i kořenem toho, proč se práce opírá především o zdroj [4], aniž by došlo k zásadnějšímu posunu definice kvadratické variace směrem ke klasické definici uváděné např. ve zdroji [1]. Tento posun by se podle mého očekávání také ve větším přínosu studenta, který je v předložené práci spíše zamlčen, ve větším příklonu ke zdroji [1] a také v nižší optické náročnosti práce.

Na závěr lze konstatovat, že práce podle všeho splňuje předpoklady kladené na bakalářskou práci na MFF UK.

Bylo téma pro bakalářskou práci přiměřené a bylo pojato přiměřeným způsobem ?	ANO, spíše obtížnější téma více méně ANO, hodil by se posun definice kv.variace
Obsahuje práce vlastní příspěvek autora ? V čem spočívá ? Je v práci dostatečně specifikován ?	ANO extrahování a rozepsání textu, přizpůsobení komp. případu NE zcela
Jaká je matematická úroveň práce ? Obsahuje práce rigorózně a korektně zformulovaný matematický text ?	až na částečný nesoulad doprovodného textu dobrá ANO
Jsou zdroje správně citovány ? Je po formální stránce vše v pořádku ?	až na položku [3] více méně ANO ANO
Lze práci uznat jako bakalářskou ?	ANO