

Posudek vedoucí na diplomovou práci

J a n a F u č í k a

## IDENTIFIKACE MODELŮ FINANČNÍCH ČASOVÝCH ŘAD

Lineární ARMA modely jsou pro svou jednoduchost, snadnou interpretovatelnost a implementaci v běžně používaných statistických softwarových produktech populární a v praxi široce využívané. Diplomant se zaměřil na problematiku jejich identifikace, to jest navržení vhodného modelu pro daná data. Práce je netriviální kompilací, shrnuje tradiční i netradiční postupy pro jednorozměrné i mnohorozměrné časové řady. Samostatným přínosem autora je simulační studie ilustrující fungování jednotlivých identifikačních procedur a jejich aplikace na reálná data z finanční praxe. Prakticky zaměřeným kapitolám předchází předhledně a srozumitelně zpracované teoretické základy.

Matematickou úroveň práce považuji za uspokojivou, student splnil zadání. Text je psán kultivovaným odborným stylem, neobsahuje závažné chyby věcné, tiskové ani jazykové. Autor pracoval samostatně a se zájmem o zvolené téma. Nastudoval partie přesahující rámec výuky v magisterském studiu oboru Finanční a pojistná matematika a prokázal schopnost prakticky použít získané znalosti. Doporučuji, aby předložená práce byla uznána jako diplomová.

V Praze 4.8.2016

RNDr. Jitka Zichová, Dr.