

Posudek

vedoucího oponenta
 diplomové bakalářské práce
Autor/Autorka: Bc. Jana Šafránková
Název práce: Mnohorozměrné modely typu ARCH a GARCH
Jméno vedoucího/opponenta: Jan Hurt

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Výsledky:

originální původní i převzaté netriviální kompilace citované z literatury opsané

Použité metody:

nestandardní standardní obojí

Aplikovatelnost:

přínos pro teorii přínos pro praxi přínos pro praxi i teorii bez přínosu nedovedu posoudit

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet méně podstatné četné závažné

Tiskové chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu a pojednávanému tématu přiměřený počet četné

Celková úroveň práce:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Práci

doporučuji nedoporučuji

uznat jako diplomovou/bakalářskou. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření vedoucího/opponenta:

Str. 10 (ii) chybí F

Str. 12 poslední řádek: Varianční matice tady musí být regulární

Str. 35 a jinde: Black, Mansson, Kroner, ... citace nejsou uvedeny v seznamu literatury

Str. 40 Pochybuji o „časové náročnosti“. V ~~matematic~~ *matematic* pro časovou řadu délky 100 výpočty trvají řádově vteřiny.

Mathematic

Místy je neobratné členění: kapitola 5 je prakticky jednostránková, odstavec o kopula modelech je na sedmi řádcích.

Místo, datum, podpis vedoucího/oponenta: Praha, 22. května 2007

Symbol získáte tak, že vpravo vedle symbolu stisknete klávesu x, symbol pak smažete.