

## Posudek

vedoucího  oponenta

diplomové  bakalářské práce

Autor/Autorka: Markéta Peterková

Název práce: Modelování rizikové premie pro úvěrové produkty finančních a kapitálových trhů

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. 19 a 50: Proč se jednou používá matice přechodu od S&P a podruhé od Moody's?

Str. 23 Co se myslí symbolem  $dS_t/S_t$  ?

Str. 25, 26 a jinde: chybí tečky na konci vět.

Str. 28, 30 a jinde: Co znamená kovariance mezi indexy?

Str. 55: Výčet použitých programových systémů je úctyhodný, pět. Stačil by jeden.

Str. 55 Jak vypadá vstupní korelační matice, která není pozitivně semidefinitní?

Str. 55 Způsob generování náhodných vektorů z mnohorozměrného normálního rozdělení zde uvedený je zcestný. Např. v systému Mathematica stačí použít funkci `RandomArray[MultinormalDistribution[...]]`.

Str. 56 Proč se náhodná čísla negenerovala přímo v systému Mathematica?

Str. 57 nešťastný symbol FV (Future Value).

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

