

Posudek vedoucí na diplomovou práci

Eduarda Hyblera

MODERNÍ PŘÍSTUPY
K ANALÝZE FINANČNÍCH ČASOVÝCH ŘAD

Tématem práce je popis a praktická demonstrace speciální metody pro identifikaci modelů mnohorozměrných časových řad. Jedná se o navržení modelu strukturální autoregrese s využitím metodologie grafických modelů, které se ukazují být užitečným nástrojem při analýze finančních dat.

Posluchač nastudoval rozsáhlé partie, které nejsou zahrnuty v předmětech jeho studijního oboru, a to problematiku vektorových ARMA modelů a základy teorie grafických modelů. Získané poznatky shrnul v teoretické části práce. Praktická část je věnována zpracování dvourozměrné časové řady měnových kurzů. Použit byl software Mathematica, diplomant modifikoval již hotové procedury.

Text je psán v češtině, která není autorovým mateřským jazykem, přehledně a srozumitelně. Posluchač pracoval na zadaném tématu samostatně a se zájmem. Prokázal schopnost seznámit se s novými netriviálními přístupy, zvládnout jejich praktickou aplikaci a interpretovat získané výsledky. Doporučuji proto uznat práci jako diplomovou.

V Praze 29.1.2008



RNDr. Jitka Zichová, Dr.