

Posudek oponentky na diplomovou práci

Jana Voříšková

NUMERICKÉ METODY VE FINANCÍCH

Předložená práce představuje možnosti uplatnění numerických metod při oceňování opcí s využitím softwaru Mathematica. Diplomant prokázal schopnost nastudovat z různých podkladů pokročilejší finančně-matematické partie a teorii k numerickým algoritmům. Z textu není zcela jasné, nakolik jsou implementace v Mathematice převzaté z literatury a nakolik jsou programovány autorem.

Matematická úroveň práce je velmi dobrá, grafická a jazyková úroveň průměrná, text obsahuje některé hrubé gramatické chyby (např. str. 8, ř. 1 a 15, str. 23, ř. 9 odspodu, str. 39, ř. 1, str. 47, ř. 5 odspodu) i chyby z nepozornosti (např. str. 8, ř. 8, str. 19, ř. 6 odspodu, str. 28, ř. 15-16).

Dále mám následující dotazy a připomínky:

str. 14, ř. 10: ... pro  $y$  z (4.4) ... vzorec (4.4) neobsahuje  $y$ ,

str. 17, ř. 16: Co je  $\bar{S}$  ?

str. 18, ř. 1 odspodu:  $V^{am}$  ... asi má být  $V_p^{am}$ ,

str. 24, ř. 4: ... Obdobně jako výpočtů transformovaná rovnice (2.4) můžeme ...  
nejasné vyjádření.

Zmíněné nedostatky neovlivňují závažným způsobem kvalitu práce, která představuje přínos pro praxi. Doporučuji uznat ji jako diplomovou.

V Praze 9.9. 2008

