

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Lucie Kračmerová

Název práce: Stochastické finance v programu Mathematica

Jméno vedoucího/opponenta: Jan Hurt

Matematická úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Grafická úroveň velmi dobrá, jazyková podprůměrná, formální průměrná.

Výsledky: nepřesně citované z literatury, částečně vlastní programové řešení

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 ojediněle 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.

Připomínky a vyjádření vedoucího/opponenta: Do strany 18 se jedná o velmi nepřesný úvod do stochastické analýzy, leckdy zmatečný (stejný symbol pro sigma algebru na pravděpodobnostním prostoru a pro filtraci, např. str. 17 a 18, souvislost prostorů uvedených v definici 13 na str. 14, pseudodefinice neanticipativní funkce na str. 11). Programová část ve značné míře čerpá z necitované přednášky Výpočetní prostředky finanční a pojistné matematiky. Celou práci se nese pokleslé vyjadřování (vrátíme transformace zpět, delta je matematický nástroj, budeme ... teorii aplikovat do programu Mathematica)

Místo, datum, podpis vedoucího/opponenta: Praha, 10. 9. 2009, Jan Hurt

