

Posudek vedoucí na diplomovou práci

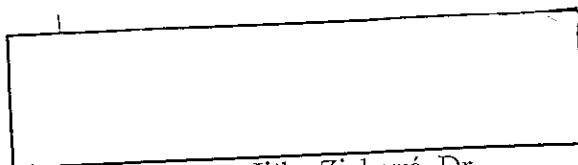
LUCIE KRAČMEROVÉ

STOCHASTICKÉ FINANCE V PROGRAMU MATHEMATICA

Softwarový produkt Mathematica představuje účinný nástroj pro formální i číselné výpočty v nejrůznějších oblastech. Cílem práce bylo demonstrovat některé jeho možnosti ve stochastické finanční matematice. Za tím účelem musela autorka pečlivě nastudovat a shrnout příslušné teoretické podklady, přičemž těžištěm práce je odvození a implementace Blackovy-Scholesovy formule. Komentované výpisy z programu Mathematica a grafické výstupy jsou částečně zabudovány přímo do textu, částečně zařazeny do přílohy.

Posluchačka pracovala samostatně a se zájmem o zvolené téma. Text je psán přehledně a srozumitelně bez závažných chyb, odborná, jazyková i grafická úroveň je velmi dobrá. Práce představuje netriviální kompilaci a vzhledem k tomu, že ukazuje vybrané softwarové možnosti v dané oblasti, považuji ji za přínosnou pro praxi. Doporučuji přijmout předložený text jako diplomovou práci.

V Praze 25.8. 2009



RNDr. Jitka Zichová, Dr.