

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Šimjáková Dominika

Název práce: Mnohorozměrné modely volatility

Jméno vedoucího/opponenta: prof. RNDr. Tomáš Cípra, DrSc.

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:

Předložená práce představuje zajímavý přehled a aplikaci modelů s podmíněnou heteroskedasticitou. Několik poznámek:

- v práci se objevují některé nevhodné či nezvyklé formulace: např. vhodnější název práce by byl → Jednorozměrné a mnohorozměrné GARCH modely; místo difference logaritmů kurzů → logaritmický výnos (log return)
- jazykovou úroveň nebyl oponent schopen posoudit, ale v anglické verzi abstraktu je špatně „simplified“, „Eviews“ (má být EViews a navíc chybí verze)
- existují modernější monografie pro mnohorozměrnou volatilitu, např. Engle (2009), Tsay (2008)

Místo, datum, podpis vedoucího/opponenta: Praha, 1. září 2009