

Posudek vedoucí na diplomovou práci


Martiny Jírů

NELINEÁRNÍ ANALÝZA ČASOVÝCH ŘAD  
A JEJÍ APLIKACE VE FINANCÍCH

Cílem práce bylo podat přehled nelineárních modelů časových řad vhodných pro finanční analýzu, a to včetně ukázek praktických aplikací. Jedná se tedy o netriviální kompilaci z různých zdrojů. Autorka zařadila k teoretickému výkladu jednotlivých modelů výsledky simulačních studií, které ukazují vlastnosti modelů, zejména z hlediska kvality odhadů při konkrétních volbách parametrů. Zkoumané modely pak byly použity na časové řady měnových kursů.

Práce je psána přehledně a srozumitelně, diplomantka se jí věnovala samostatně a se zájmem. Prokázala schopnost nastudovat značný objem literatury, získané poznatky utřídit a s pomocí vhodného softwaru provádět numerické studie a zpracovat reálná data. Doporučuji přijetí práce k obhajobě.

V Praze 16.5.2006



RNDr. Jitka Zichová, Dr.