

## Posudek

vedoucího oponenta  
diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Jan Kubů

Název práce: Testování hypotéz ve finančních časových řadách

Jméno vedoucího/oponenta: Mgr. Petr Jonáš

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/oponenta:

V práci je poměrně velké množství opravitelných nepřesností. Například v úvodu by bylo potřeba věnovat více pozornosti oboru hodnot indexů (např. definice 1.3). K některým definicím je potřeba doplnit další předpoklady. (rozptyl v definici 1.9). Dále často není jasné, proti jaké alternativě nulovou hypotézu testujeme. K práci bych měl následující dotazy.

1. Platí tvrzení 2.5 i bez dodatečných předpokladů? Např. na rozptyl?

2. Hypotézou náhodné procházky testujeme nekorelovanost náhodných veličin. Autokorelační test „ $r_1$ “ je založen na tvrzení 2.5, které má v předpokladech nezávislost náhodných veličin. Je to v pořádku?

3. V podkapitole 3.3.3. testujeme nulovou hypotézu na časové řadě transformované pouze transformací (3.1). Proč netestujeme i na řadě transformované pomocí (3.3)?

Místo, datum, podpis vedoucího/oponenta:

Praha, 22.6.2012, Mgr. Petr Jonáš