

Posudek vedoucí na bakalářskou práci

Jana Kubů

TESTOVÁNÍ HYPOTÉZ

VE FINANČNÍCH ČASOVÝCH ŘADÁCH

Finanční data mají často podobu časových řad. Pokud chceme jejich chování matematicky popsat, musíme identifikovat vhodný model. V té souvislosti se testují hypotézy o shodě teoretických modelů časových řad s pozorovanými daty. Autor práce se zaměřil na problematiku testování hypotézy náhodné procházky. Pracoval s knihou Taylor: Modelling Financial Time Series (Wiley, 1995) a doplňkovými zdroji. Nastudoval různé typy testů zmíněné hypotézy a provedl odvození některých jejich vlastností, která nejsou v literatuře podrobně rozpracována. Fungování jednotlivých testů ověřil na reálných datech z finanční praxe i na simulovaných datech s použitím softwaru Mathematica 8.0.

Na zvoleném tématu pracoval samostatně, aktivně a se zájmem. Rozšířil si znalosti získané při výuce a prokázal schopnost prakticky aplikovat získané teoretické poznatky. Text je přehledně uspořádán, neobsahuje závažné věcné ani tiskové chyby. Praktické výsledky jsou shrnuty do komentovaných tabulek. Po matematické i grafické stránce má práce kvalitní úroveň. Doporučuji, aby byla přijata jako bakalářská.

V Praze 25.5.2012

RNDr. Jitka Zichová, Dr.