

Posudek

vedoucího oponenta
diplomové bakalářské práce

Autor: Jakub Marčiny

Název práce: Grangerova kauzalita ve finančních časových řadách

Jméno vedoucího: Voříšek Jan

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 bakalářskou. Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření vedoucího:

Autor prokázal schopnost porozumět a samostatně zpracovat téma vícerozměrných časových řad, které není v osnovách bakalářského studijního oboru Finanční matematika. Pomocí samostatně naprogramovaných výpočtů v programu *Mathematica* testoval Grangerovu a okamžitou kauzalitu na datech z finančních trhů. Pracoval se zájmem a v závěru práce samostatně navrhl, že v pokračování práce by se dalo zaměřit na víceřadovou kauzalitu a míry kauzality.

Praha, 2.9.2011
Voříšek Jan