

Hynek Hilbert
Kvantifikace víceroměrných rizik
posudek vedoucího diplomové práce

V poslední době je věnována modelování extrémů náhodných vektorů značná pozornost. Určitě to souvisí s finanční krizí z roku 2008, ale toto téma bylo studováno již předtím, bohužel však jen mezi teoretiky. Problémem zůstává pochopit, co je ve více rozměrech extrémem a co není. Jedním z přístupů je takzvaný geometrický přístup, který je zpracován v předložené diplomové práci. Jde o téma velice náročné a cílem práce nebylo odvozovat nové teoretické výsledky, ale pochopit princip geometrického přístupu, porovnat jej s klasickým přístupem souřadnicovým a také jej zhodnotit a interpretovat v souvislosti s ekonometrickými modely. Tohoto cíle bylo podle mého dosaženo a zadání diplomové práce tím bylo splněno.

O obsahu práce psát nebudu. Vyjádřím se raději k práci diplomanta. Bylo mým velkým potěšením pozorovat, jak roste jeho porozumění náročnému textu. Že si postupně dokáže získat nadhled a vlastní názor na tuto problematiku. A snad se moc nemýlím, když napíšu, že se mu toto téma i zalíbilo.

Na práci by samozřejmě bylo možné zlepšit mnohé. Působí občas trochu nedotaženě, některé obraty třeba trochu kostrbatě; je to však autorův vlastní jazyk, velmi oceňuji, že diplomant dal na mou radu a snažil se vše sepsat tak, jak tomu rozumí, ne tak, jak to jiní napsali již před ním. Bohužel, čas tlačil a tak na některé zajímavé otázky již nedošlo a v práci se neobjevují. Práce však i tak je svým rozsahem spíš nadprůměrná, uvážíme-li, že neobsahuje žádné simulační ani datové příklady.

Celkově jsem s prací spokojen a doporučuji **ji uznat jako diplomovou.**

Daniel Hlubinka
11.9.2013