

Posudek vedoucího bakalářské práce:

BARBORA LEBDUŠKOVÁ: KOPULE A MODELOVÁNÍ ZÁVISLOSTÍ

Hlavním přínosem předložené práce je přehledné představení základních vlastností kopulí.


První tři kapitoly obsahují zejména definice a přehled základních vlastností kopulí, který je doplněn o vhodně zvolené a pěkně vypracované příklady, Čtvrtá kapitola obsahuje přehled několika parametrických kopulí včetně jejich základních vlastností. Pátá kapitola stručně popisuje princip parametrických, neparametrických a semi-parametrických odhadů kopulí.

Vlastním přínosem Barbory Lebduškové je zejména:

1. přehledné zpracování zadaného tématu,
2. příklady a ilustrace ve třetí kapitole,
3. odvození základních vlastností kopulí představených ve čtvrté kapitole,
4. grafické porovnání zvolených parametrických kopulí s Frechet-Hoeffdingovými mezemi a součinnou kopulí v kapitole 4,
5. shrnutí metod odhadů kopulí v kapitole 5 včetně odkazů do literatury.

Při dokončování předložené práce bohužel došlo ke zhruba dvoutýdennímu zdržení způsobenému souhrou chybných konfigurací poštovního serveru, spamového filtru a programu SquirrelMail na karlínském serveru a navíc ještě další neznámou chybou na serveru "centrum.cz". Slečně Lebduškové se práci podařilo včas dokončit i přes tyto nepříjemné a neočekávané technické problémy.

Předložená práce byla zpracována samostatně a pečlivě a doporučuji ji uznat jako bakalářskou práci.



RNDr. Zdeněk Hlávka, Ph.D.