

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Ružena Nistorová

Název práce: Oceňování úrokových derivátů pomocí LIBOR tržního modelu (LMM)

Jméno vedoucího/opponenta: RNDr. Jitka Zichová, Dr.

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.

Připomínky a vyjádření oponenta:

Posluchačka prokázala schopnost porozumět netriviální problematice a prakticky ji aplikovat s využitím vhodného softwaru. Text je psán ve slovenském jazyce kultivovaným odborným stylem. Mám k němu následující dotazy připomínky:

str. 3, ř. 18: co je filtrovaný průměr ?

str. 7 a dále: pro opci na swap se používá název swapec. Je to oficiální slovenský termín ? V češtině se (viz např. Cipra: Matematika cenných papírů) se používá ženský rod swape, lépe odpovídající anglickému swaption.

str. 7, ř. 18-19: výrazy at-the-money, in-the-money, out-of-money by mohly být přeloženy do slovenštiny, v češtině se používají (viz opět Cipra: Matematika cenných papírů) spojení na penězích, v penězích, mimo peníze.

str. 10, ř. 2 odspodu: odkaz by měl být na (1.12) místo (1.13).

str. 20, ř. 1-2: jak je z rovnice (4.4) zřejmé, že simulace kopírují vývoj forwardové křivky z trhu ?

str. 38, tabulka 5.5: proč jsou v ní na některých místech výrazy NA ?

V Praze 25.1.2013

RNDr. Jitka Zichová, Dr.