

Posudek vedoucí bakalářské práce

Jméno a příjmení autora posudku: Jitka Dupačová

Jméno a příjmení autora práce: Hana Koláčková

Název práce: Generování scénářů při požadavku na shodu momentů

Posluchačka se zabývala postupy pro generování scénářů tak, aby získané diskrétní rozdělení vyhovovalo požadavkům na hodnoty prvních a druhých momentů. Rozpracovala několik variant pro případ jednorozměrných a dvojrozměrných rozdělení. Při tom si doplnila své znalosti konvexních funkcí, optimalizace a použití odpovídajícího software. Pracovala především s Mathematicou a také s GAMSem, využila data z webové stránky [3] a software R na výpočet momentů. Pokusila se o porovnání a zhodnocení výsledků získaných alternativními postupy.

Správně vyloučila postup založený na vyhledávání všech $\$S\tic v reálných datech „Výběr z reálných dat“ pro jeho vysokou numerickou náročnost (odst. 4.2.2, program v C++). Metodu 2.2.1 použila pro jednorozměrná data, ale není jasné její použití na větší dimenzi (závěr odstavce 2.1.1 by při obhajobě měla vysvětlit).

Práce má poměrně velký rozsah, je dán mj. rozepisováním úloh po složkách (např. (1.2), (3.4), (3.9) a str. 29, 38, 39) a málo přehlednou prezentací numerických výsledků. Podobné vysvětlivky se opakují několikrát.

Autorka se v podstatě věnovala pouze jednorozměrnému případu, o zadaných hodnotách druhých smíšených momentů se zmínila okrajově. Tomu také odpovídají závěry týkající se vlivu vah na řešení. Je také škoda, že výsledky neporovnala na nějaké skutečné úloze místo porovnání v grafu. Mezi přílohami chybí zdrojové kódy postupů v C++, přiložena je jen výsledná aplikace. Zadání práce splnila na nezbytné minimální úrovni.

Doporučení k obhajobě:

Z výše uvedených důvodů práci *doporučuji* k obhajobě.

V Praze dne:

Podpis: