

Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Bc. Kristýna Ilgnerová
Číslo studenta: E150025
Název diplomové práce: Modely volatility a jejich užití pro modelování kurzů měn
Cíl práce: Cílem práce je představit modely volatility a ukázat jejich aplikaci na modelování kurzů vybraných měn.
Vedoucí práce: Mgr. David Zapletal, Ph.D.
Studijní program: N6209 Systémové inženýrství a informatika
Akademický rok: 2017/2018

Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vstupní údaje a jejich zpracování	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Použité metody	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Kritéria hodnocení práce

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Stupeň splnění cíle práce	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Původnost zpracování tématu	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Adekvátnost použitých metod	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Logická stavba práce a rozsah	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Práce s českou a zahraniční literaturou včetně citací	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Formální úprava práce (text, grafy, tabulky)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Jazyková úroveň (styl, gramatika, terminologie)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Využitelnost výsledků práce

	vysoká	střední	nízká	nelze hodnotit
Pro teorii	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Pro praxi	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Ostatní připomínky k práci

Práce je psána jasně a srozumitelně bez podstatných chyb a nepřesností. Volbu časových řad (kurz CZK/EUR a CZK/USD) podrobených analýze lze určitě pokládat za logickou. Ovšem vzhledem ke skutečnosti, že se, poněkud překvapivě, ani v jednom případě neprokázala nutnost aplikovat modely volatility, je k diskuzi, zda by nebylo vhodné práci doplnit o časovou řadu, kde je aplikace modelu volatility nezbytná.

Vyjádření k výstupům ze systému Theses

Nepovažuji za plagiát, protože míra shody je menší než 5 %.

Otázky a náměty k obhajobě

Objasněte pojem pákový efekt a uveďte příklady modelů volatility, které jsou na rozdíl od modelu GARCH schopny tento efekt zohlednit.

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.

Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **B - výborně mínus**

V Pardubicích 17.5.2018

Podpis