

Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Bc. Jakub Šulc
Číslo studenta: E15659
Název diplomové práce: Analýza úrokových sazeb peněžního trhu v ČR
Cíl práce: Cílem práce je zpracovat přehled a popsat konstrukci úrokových sazeb užívaných na peněžním trhu v ČR. Jejich vývoj pak popsat zejména formou analýzy jejich časových řad.
Vedoucí práce: Mgr. David Zapletal, Ph.D.
Studijní program: Systémové inženýrství a informatika
Akademický rok: 2016/2017

Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	☐	☒	☐	☐	☐
Vstupní údaje a jejich zpracování	☒	☐	☐	☐	☐
Použité metody	☐	☒	☐	☐	☐

Kritéria hodnocení práce

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

Využitelnost výsledků práce

	vysoká	střední	nízká	nelze hodnotit
Pro teorii	☐	☒	☐	☐
Pro praxi	☐	☒	☐	☐

Identifikace záznamu:
Agenda závěrečných prací

.....

Ostatní připomínky k práci

Práce je psána jasně a srozumitelně bez podstatných chyb a nepřesností. V prvních třech kapitolách se autor věnuje problematice monetární politiky, centrálního bankovníctví a konstrukci úrokových sazeb ČNB. Ve čtvrté kapitole jsou pak stručně popsány metody, které jsou pak využity pro modelování vybraných úrokových sazeb v páté kapitole.

Ocenit lze právě využití poměrně netriviálních metod a modelů pro analýzu vybraných časových řad v závěrečné kapitole, zejména modelů volatility GARCH a IGARCH. V jejich zejména teoretickém popisu ovšem měl být autor poněkud sdílnější. Práce má také několik drobných formálních nedostatků, jako jsou chybějící interpunkční znaky zejména ve 4. kapitole, několik chybných odkazů v textu na obrázky, případně číslování části Závěr.

Otázky a náměty k obhajobě

U obhajoby autora žádám, aby uvedl, zda na některou z úrokových sazeb měl podstatný vliv konec měnových intervencí ČNB v dubnu letošního roku.

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.

Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **velmi dobře**

V Pardubicích 1.9.2017

Podpis