

Posudek

vedoucího oponenta

diplomové bakalářské práce

Autor/Autorka: Barbora Janečková

Název práce: Aplikace 2-dimenzionálních rozdělání v bankovníctví

Jméno oponenta: Doc. RNDr. Petr Lachout, CSc

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 bakalářskou.

Návrh klasifikace přikládám na zvláštním papíru.

Připomínky a vyjádření oponenta:

Práce se zabývá sdruženým rozdělením dvou reálných náhodných veličin a uvažuje jeho reprezentaci pomocí kopulí. Přehledně shrnuje teorii kopulí a předvádí různé míry závislosti dvou náhodných veličin. Teorii v závěrečné kapitole aplikuje na empirická data cen akcií společností IBM a Nestlé. K práci mám následující připomínky: Co označuje D_f ? Nepřesná definice 6. Podivné výpočty na konci str. 14.

Místo, datum, podpis oponenta: Praha, 30.8.2007