

Posudek oponentky na bakalářskou práci

M i c h a l a T v r d í k a

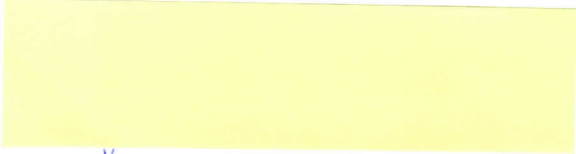
SIMULAČNÍ METODY
PŘI HODNOCENÍ CENNÝCH PAPÍRŮ

Předložený text je zaměřen na problematiku metod Monte Carlo vzhledem k jejímu využití v oblasti financí. Důraz je kladen na různé přístupy k redukci rozptylu odhadu metodou Monte Carlo. Samostatným přínosem autora je vytvoření programu v systému Mathematica, který aplikuje popsané přístupy na evropskou call opci.

Text je psán přehledně, obsahuje přiměřené množství tiskových chyb. Na některých místech by bylo možné doporučit jeho lepší grafickou úpravu, zmiňme např. ne zcela vhodné použití znaku \Rightarrow jako symbolu konvergence v distribuci na str. 11 a 13, nejednotnou velikost písma ve vzorcích na str. 16 či znak sjednocení na str. 20.

Lze konstatovat, že posluchač prokázal schopnost seznámit se s netriviálními teoretickými podklady a zpracovat simulační studii, čímž splnil úkoly ze zadání práce. Doporučuji proto uznat práci jako bakalářskou.

V Praze 19.8. 2007



RNDr. Jitka Zichová, Dr.