

Posudek k bakalářské práci *Miroslava Stacha*:

Viskózní řešení diferenciálních rovnic a aplikace ve financích

Bakalářská práce ve své první části představuje úvod do teorie nelineárního řízení založené na pojmu viskózního řešení rovnice dynamického programování. Zbylá část je založena na symbolickém přístupu ke stochastickému diferenciálu a je věnována problému optimálního investování při proporcionálních transakčních nákladech.

Celkově je práce citlivě napsaná a na úrovni, které může dosáhnout student bakalářského studia. Přečíst by si ji měl student, kteří se se chce seznámit s principy nelineárního řízení nebo s využitím stochastického diferenciálu ve financích dříve než se rozhodne pro budoucí studium stochastické analýzy.

Práce splňuje všechny požadavky, které byly uvedeny v zadání, a lze ji tak uznat jako bakalářskou práci na MFF UK.

5.9.07 Praha

Petr Dostal.