

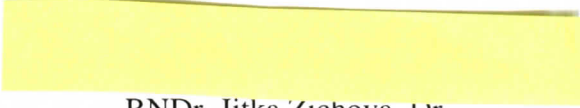
Posudek vedoucí na diplomovou práci

Martina Hrbý

APLIKACE MODELŮ MNOHOROZMĚRNÝCH
ČASOVÝCH ŘAD VE FINANČNÍ ANALÝZE

Cílem práce bylo ukázat některé možnosti aplikací modelů mnohorozměrných časových řad na finanční data. Diplomant nastudoval teorii vícerozměrných ARMA modelů a získané znalosti použil pro zpracování řad měnových kurzů a burzovních indexů. K tomu účelu vytvořil programy pro analýzu časových řad s využitím systému Mathematica. Na tématu pracoval naprosto samostatně a s velkým zájmem. Prokázal schopnost seznámit se s náročnějšími partiemi, které přesahují rámec výukových osnov, a prakticky je aplikovat. Práce je napsána pečlivě a srozumitelně. Ukazuje, že lineární modely mnohorozměrných časových řad mohou být při dostupnosti vhodného softwaru užitečným nástrojem pro analýzu dat z oblasti financí. Doporučuji přijetí práce k obhajobě.

V Praze 16.5.2006



RNDr. Jitka Zichová, Dr.