

Hodnocení vedoucího bakalářské práce

Autor/Autorka

Karolína Hylasová

Název práce

Aplikace kopulí ve financích

Studijní obor

Matematika a její aplikace

Vedoucí práce

RNDr. Blanka Šedivá, Ph.D.

Splnění cílů práce:

nadstandardně velmi dobře splněny s výhradami nebyly splněny

Odborný přínos práce:

nové výsledky netradiční postupy zpracování výsledků z různých zdrojů shrnutí výsledků z různých zdrojů bez přínosu

Matematická (odborná) úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu přiměřený počet méně podstatné, větší množství podstatnější, větší množství závažné

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Přístup autora k řešení práce, spolupráce s vedoucím práce:

samostatná práce s výbornou komunikací pečlivá práce, drobné zásahy vedoucího pečlivá práce, podstatnější zásahy horší komunikace špatný přístup k práci

Slovní hodnocení a dotazy:

Předložená bakalářská práce se věnuje tématu kopulí, které integruje znalosti z oblasti funkcí více proměnných a pravděpodobnosti a statistiky. Pro pochopení problematiky bylo třeba nastudovat celou řadu, převážně anglicky psané, literatury. Bohužel ne vždy se autorka s daným úkolem vypořádala úspěšně. Zvláště poslední část práce působí chaoticky a nepřehledně.

V první části práce jsou uvedeny základní pojmy a tvrzení, text je zpracován z různých zdrojů a teoretická tvrzení jsou doplněna i ilustrativními příklady. V druhé části práce se autorka zaměřila na třídu Archimédovských kopulí, text je opět doplněn vlastními ilustrativními obrázky a příklady. V této části textu se jedná o matematický výklad dané problematiky ve stylu definice – věta – důkaz. Text by si zasloužil důkladnou revizi tak, aby byly odstraněny nepřesnosti a formální nedodělky. U některých důkazů by bylo vhodné je ještě podrobněji rozepsat tak, aby bylo zřejmé, že autorka pochopila jejich strukturu. Poslední kapitola práce je věnována ukázce možného použití kopulí ve financích. Také tato část by měla být daleko propracovanější a měla by odrážet systematictější přístup, z textu není zřejmé, zda autorka problematiku plně pochopila. Původně ambiciózní cíl aplikování teoretických poznatků na reálná data a důsledná interpretace získaných výsledků se nepodařilo zcela naplnit a tak závěrečná kapitola slouží pouze k demonstraci možných postupů na vybrané skupině akcií.

Přístup autorky k vypracování práce byl ovlivněn nemožností osobních konzultací v klíčovém období přípravy práce a následným časovým tlakem na dokončení práce. Kladně hodnotí snahu autorky seznámit se s novými poznatky, které v některých oblastech významně přesahovaly standardně vyučovanou látku v bakalářském stupni studia.

Mé závěrečné hodnocení práce odráží především osobní přístup studentky směřovaný k porozumění danému tématu, její intenzivní snahu pochopit teoretické zázemí daného problému a na příkladech uchopit a demonstrovat základní principy. Text práce pak odráží schopnost studentky samostatně zpracovat matematický text, a ačkoliv trpí celou řadou nedostatků a zasloužil by si pečlivější dopracování, doporučuji uznat předloženou práci jako vyhovující bakalářskou kvalifikační práci.

Navrhují hodnocení známkou:

DOBŘE

Datum, jméno a podpis: