

Průběh obhajoby diplomové práce:


Student prezentoval výsledky své diplomové práce a zodpověděl následující dotazy.

- 1) z jakých počítačnických odhadů parametru vycházíte při odhadech MLE?
- 2) jakým způsobem je odhadování vykonáváno? Existuje možnost?
- 3) Můžete alespoň jeden efektivní způsob, jak z maximálních trajektorií Lévyho procesu vypočítat odhad střední hodnoty a rozptylu. Ukažte příklad na dvou Poissonových procesech.
- 4) Popište teoretický rozdíl v tzv. realizované volatilitě pro Normalní model a pro obě Lévyho procesy.
- 5) Popište rozdíl oproti práci Panoš (2014).

Klasifikace:

výborně

Datum obhajoby: 15. června 2016



 podpis zkoušejícího