

Posudek vedoucího diplomové práce

Autor práce (jméno a příjmení)	Eliška VRÁNOVÁ
Název práce	Modelování volatility na vybraném akciovém trhu
Název a typ studijního programu	Systémové inženýrství a informatika / Navazující
Fakulta / katedra	Ekonomická fakulta / KMI
Vedoucí práce	Rost Michael, Ing. Ph.D.
Autor posudku	Ing. Michael Rost Ph.D.

Hodnocení práce

1. Logická struktura práce 1.5
2. Naplnění cíle práce 2.0
3. Metodický postup 1.0

Poznámka: Pozitivně hodnotím skutečnost, že se autorka zcela samostatně vypořádala s programovacím prostředím R.

4. Hodnocení teoretického a/nebo praktického přínosu práce 2.0
5. Práce s literaturou 1.0
6. Formální stránka 3.0
7. Vlastní přínos studenta k řešené problematice 2.0
8. Kontrola plagiátorství (výsledek) **negativní**

Závěr

Hodnocení práce známkou: **velmi dobře**

Doporučuji práci k obhajobě: **ANO**

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce

Předložená diplomová práce slečny Elišky Vránové s názvem "Modelování volatility na vybraném akciovém trhu" se zabývá vysvětlením a modelováním volatility u akcií podniku ČEZ, Erste Group Bank, komodit zlata a stříbra na příslušných trzích. Samotná práce je rozčleněna do 5 logických celků. Pro modelování volatility jsou použity modely ARCH, GARCH, EGARCH, GJRARCH. Numerické vyhodnocení bylo provedeno prostřednictvím programovacího prostředí R. Za přínosné považuji přehledné zpracování studované problematiky v rešeršní části. Velmi kladně hodnotím skutečnost, že autorka při zpracování práce prokázala schopnost samostatně zpracovat údaje plynoucí z časových řad prostřednictvím relativně obtížného statistického aparátu. Na druhou stranu, se v práci vyskytují určité nepřesnosti. Rovněž postrádám zevrubnější popisy v praktické části práce. Práce drobně trpí po formální jazykové stránce.

Posuzovaná práce přesto splňuje požadavky kladené na tento typ závěrečných prací, a proto práci slečny Elišky Vránové doporučuji k obhajobě a hodnotím známkou velmi dobře.

Ing. Michael Rost, Ph. D.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Co je index VIX? K čemu se využívá, a jak jej případně modelovat?

Datum: 20.09.2016

Podpis vedoucího diplomové práce