

# Posudek vedoucího bakalářské práce

|  |  |
|--|--|
| <b>Jméno a příjmení studenta</b>       | František ŽIŠKA                                  |
| <b>Název práce</b>                     | Výpočet hodnoty v riziku v R                     |
| <b>Název a typ studijního programu</b> | Systémové inženýrství a informatika / Bakalářský |
| <b>Fakulta / katedra</b>               | Ekonomická fakulta / KMI                         |
| <b>Vedoucí práce</b>                   | Mrkvička Tomáš, doc. RNDr. Ph.D.                 |
| <b>Autor posudku</b>                   | doc. RNDr. Tomas Mrkvicka Ph.D.                  |

## Posudek závěrečné práce

1. Logická struktura práce 2.0
2. Naplnění cíle práce 2.0
3. Metodický postup 2.0
4. Hodnocení teoretického a/nebo praktického přínosu práce 1.0
5. Práce s literaturou 1.5
6. Formální stránka 2.0
7. Vlastní přínos studenta k řešené problematice 2.0
8. Kontrola plagiátorství (výsledek) **negativní**

## Závěr

Hodnocení práce (známka): **velmi dobře**

Doporučuji práci k obhajobě: **ANO**

## Otázky pro diskusi a poznámky

### Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce

Předložená práce je kvalitním zpracováním základních algoritmů pro výpočet VaR v R. Algoritmy jsou zpracovány dle požadavků vedoucího práce a dokonce jsou využívány pro následné aplikace studia VaR. Nicméně vedoucí práce by viděl rád v práci např. ještě další algoritmus či nějaké srovnání výsledků. To vzhledem k nedostatku času není již v práci zahrnuto. Ovšem práce ukazuje, že student je schopen se vypořádat se samostatným zpracováním softwarového projektu.

### Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Jaké jsou výhody/nevýhody programovacího prostředí R vzhledem k běžným programovacím prostředím.

Popište co je to kumulativní distribuční funkce a kde byla ve vaší práci využita.

Popište, co jsou to těžké chvosty rozdělení a kde se s nimi ve vaší práci setkáváme.

Datum: 27.04.2021

Podpis vedoucího práce