

Posudek oponenta bakalářské práce

Autor (jméno, příjmení): Tomáš Šmarda

Název bakalářské práce: Matematické modelování ceny zlata

Studijní obor: Finanční a pojistná matematika

Fakulta/katedra: Ekonomická fakulta, Katedra aplikované matematiky a informatiky

Oponent bakalářské práce: Mgr. Jiří Kopecký

Obor profesního působení: Matematika, statistika, stochastické procesy

Hodnocení práce

1. **Význam a náročnost tématu:** 100 %
2. **Logická struktura práce:** 100 %
3. **Naplnění cíle práce:** 75 %
4. **Metodologický postup:** 100 %
5. **Hodnocení teoretického zobecnění a přínosu:** 50 %
6. **Praktický přínos práce:** 50 %
7. **Práce s literaturou:** 75 %
8. **Formální stránka:** 100 %

Závěr

Výsledek: 80 bodů

Návrh hodnocení práce známkou: výborně

Doporučuji práci k obhajobě: ANO

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce:

Předložená bakalářská práce se zabývá analýzou časových řad a základními modely volatility aplikovaných na vývoj ceny zlata od 29.12. 1978 do 28.9. 2012. V teoretické části student prokázal pochopení obtížných statistických metod a modelů, které aplikoval a porovnal v praktické části. V závěru autor navrhuje také využití dalších a složitějších modelů, které by však přesahovaly rozsah BP. Po formální stránce bych vytknul nejednotný popis souvisejících grafů.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí:

Vybrané téma je velmi aktuální. V posledních měsících se otočil trend vývoje ceny zlata. Proč jste do práce nezahrnul novější data, tedy ceny alespoň z počátku roku 2013? Jak odhadujete možnosti praktického využití vybraných modelů pro investice do zlata?

Datum: 20. 05. 2013

Podpis oponenta bakalářské práce:

