

Posudek vedoucí na diplomovou práci

Adriána Andráše

VYBRANÉ METODY PRO ANALÝZU  
MNOHOROZMĚRNÝCH FINANČNÍCH DAT

Diplomová práce podává výklad a praktickou ilustraci dvou možných přístupů ke zpracování mnohorozměrných časových řad, které se často vyskytují ve finančních databázích. Grafické modely umožňují vyšetřit strukturu podmíněných nezávislostí složek vícerozměrné řady, zatímco vektorové ARMA modely popisují vývoj chování řady v čase. Teoretické základy grafických i mnohorozměrných ARMA modelů představovaly pro posluchače zcela novou látku k nastudování a pochopení. V práci jsou získané poznatky přehledně a srozumitelně sepsány. Pro analýzu dat byla zvolena množina měnových kurzů. Použit byl program Mathematica a v něm implementované procedury pro odhady a testování v grafických a ARMA modelech. Výsledky jsou shrnuty v četných tabulkách a grafech, autor se pokusil o jejich interpretaci a vysvětlení příčin.

Práce je psána ve slovenském jazyce. Její matematickou, jazykovou i grafickou úroveň považuji za velmi dobrou. Posluchač pracoval samostatně a se zájmem o zvolené téma. Prokázal schopnost seznámit se s netriviální teoretickou problematikou a prakticky ji použít. Vzhledem k tomu, že zejména grafické modely nejsou všeobecně rozšířeným nástrojem statistické analýzy, je předložený text přínosný pro finanční praxi. Doporučuji proto uznat jej jako diplomovou práci.

V Praze 24.8.2011

RNDr. Jitka Zichová, Dr.