

Hodnocení vedoucího diplomové práce

Autor/Autorka

Diana Študentová

Název práce

Vybrané metody odhadů výnosových křivek a jejich aplikace na reálná data

Studijní obor

Finanční informatika a statistika

Vedoucí práce

RNDr. Blanka Šedivá, Ph.D.

Splnění cílů práce:

nadstandardně velmi dobře splněny s výhradami nebyly splněny

Odborný přínos práce:

nové výsledky netradiční postupy zpracování výsledků z různých zdrojů shrnutí výsledků z různých zdrojů bez přínosu

Matematická (odborná) úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Věcné chyby:

téměř žádné vzhledem k rozsahu přiměřený počet méně podstatné, větší množství podstatnější, větší množství závažné

Grafická, jazyková a formální úroveň:

vynikající velmi dobrá průměrná podprůměrná nevyhovující

Přístup autora k řešení práce, spolupráce s vedoucím práce:

samostatná práce s výbornou komunikací pečlivá práce, drobné zásahy vedoucího pečlivá práce, podstatnější zásahy horší komunikace špatný přístup k práci

Slovní hodnocení a dotazy:

Předkládaná diplomová práce je zaměřena na aktuální ekonomicko-statistické téma. Autorka se daným tématem zabývala již v rámci bakalářského studia a tak při zpracování tohoto tématu využila své široké znalosti. Autorka pro odhady výnosových křivek vycházela z modelů ekonomického charakteru (Nelson-Sieglův model a Svenssonův model), z obecných regresních modelů (polynomiální aproximace, aproximace Gompertzovou křivkou a lineárně logaritmicovou křivkou) a dále z přístupu založeného na interpolaci kubickými splíny. Pro všechny navržené metody odhadů autorka naprogramovala a otestovala skripty v programu Matlab. Pro praktickou realizaci odhadů byly vybrány sady dat ze dvou různých časových okamžiků pro tři zvolené státy.

Výsledky všech odhadů jsou navzájem porovnány a to jak z hlediska různých časových okamžiků, tak je provedeno porovnání mezi jednotlivými státy.

Dotazy k rozpravě:

1. Podle jakého hlediska byly pro konkrétní výpočty vybrány právě státy ČR, Německo a Rakousko ?
2. Jakým způsobem lze z odhadnutých spotových křivek získat odhady křivek forwardových ?

Navrhují hodnocení známkou:

VÝBORNĚ

Datum, jméno a podpis:

 12.6.2019