

Posudek vedoucího diplomové práce

Student: Bc. Jindřich Röhrich
Číslo studenta: E17535
Název diplomové práce: Fraktální analýza časových řad ve finanční praxi
Cíl práce: V práci budou popsány základní matematické pojmy a nástroje spojené s aplikací poznatků fraktální geometrie na studium časových řad. Analýza konkrétních časových řad z oblasti finanční praxe bude doplněna kritickým zhodnocením výsledků a možností uvedené metody.
Vedoucí práce: Mgr. Libor Koudela, Ph.D.
Studijní program: Systémové inženýrství a informatika
Akademický rok: 2018/2019

Náročnost tématu

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Teoretické znalosti	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Vstupní údaje a jejich zpracování	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Použité metody	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Kritéria hodnocení práce

	výborně	velmi dobře	vyhovující	nevyhovující	nelze hodnotit
Stupeň splnění cíle práce	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Původnost zpracování tématu	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Adekvátnost použitých metod	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Hloubka provedené analýzy (ve vztahu k tématu)	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Logická stavba práce a rozsah	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Práce s českou a zahraniční literaturou včetně citací	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Formální úprava práce (text, grafy, tabulky)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Jazyková úroveň (styl, gramatika, terminologie)	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Využitelnost výsledků práce

	vysoká	střední	nízká	nelze hodnotit
Pro teorii	<input type="checkbox"/>	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
Pro praxi	<input checked="" type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

Identifikace záznamu:

Agenda závěrečných prací

.....

Ostatní připomínky k práci

Diplomová práce se zabývá zcela novým přístupem – fraktální analýzou časových řad. Diplomant prokázal schopnost porozumět netriviálním metodám zpracování dat, které v závěru práce aplikoval. Velmi kladně hodnotím použití reálných časových řad z pojišťovnictví, které však dle výsledků ukazují svou nepředvídatelnost. Diplomová práce má logickou strukturu a díky kvalitní úpravě je srozumitelná a poutavá i pro neakademické publikum.

Otázky a náměty k obhajobě

- 1) Vysvětlíte, proč jsou všechny zkoumané časové řady antiperzistentní.
- 2) Jaký fraktál je, dle Vašeho názoru, nejkrásnější?

Závěrečné hodnocení

Práci **doporučuji** k obhajobě.
Tuto diplomovou práci navrhuji hodnotit známkou: **A**

V Pardubicích 27.5.2019

Podpis
Mgr. Jana Heckenbergerová, Ph.D.