

# OPONENTSKÝ POSUDEK BAKALÁŘSKÉ PRÁCE



**Katedra:** Katedra ekonometrie

**Student:** Kateřina Nováková

**Oponent bakalářské práce:** Mgr. Vladimír Holý

**Pracoviště a funkce:** Interní doktorand na katedře ekonometrie

**Téma bakalářské práce:** Metody kvantifikace rizika při nastavení limitu expozice brokerských společností

## Hodnocení práce

**1 2 3 4 5**

hodnocení: 1 = nejlepší, 5 = nejhorší

|                                                        |                                     |                                     |                          |                          |                          |
|--------------------------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 1. Formulace cílů práce a metodika zpracování          | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 2. Práce s daty a informacemi                          | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 3. Členění práce (kapitoly, podkapitoly, odstavce)     | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 4. Práce s odbornou literaturou (citace, norma)        | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 5. Úroveň jazykového zpracování                        | <input type="checkbox"/>            | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 6. Přesnost formulací a práce s odborným jazykem       | <input type="checkbox"/>            | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 7. Formální zpracování                                 | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 8. Splnění cílů práce, závěry práce a jejich formulace | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 9. Souhrn a klíčová slova odpovídají obsahu práce      | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 10. Celkové hodnocení práce známkou (1, 2, 3, 4)       | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

## Otázky k obhajobě

Použití jaké míry rizika byste doporučila pro brokerskou společnost? Spíše Value-at-Risk nebo Expected Shortfall?

## Další připomínky, vyjádření, náměty k obhajobě práce

Vzorec (4) na str. 14 je chybně zapsaný.

Pro budoucí práci doporučuji zahrnout do simulací kurzů skoky v cenách, které se ve finančních časových řadách často vyskytují a značně ovlivňují riziko.

**Datum:** 13.6.2017

**Podpis oponenta bakalářské práce**