

Hodnocení vedoucího diplomové práce

Autor/Autorka

Vladimír Puhlovský

Název práce

Kombinované opční strategie

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: na druhé straně

Práce je zaměřena na problematiku kombinovaných opčních strategií a jejich vhodnou volbu. Struktura práce je logická a odpovídá Zásadám specifikovaným v zadání práce. Po teoretických kapitolách shrnujících poznatky o opcích a opčních strategiích z literatury autor přistoupil k vlastním zpracování dat. Zásadní je tak algoritmus hledání optimální opční strategie navržený na straně 55. Provedené numerické experimenty ukázaly na použitelnost tohoto postupu. Bohužel se nepodařilo algoritmus optimalizovat z pohledu výpočetní složitosti a princip metody je založen na „procházení“ všech možných kombinací opcí. Tím jsou určeny i možnosti pro počet opcí zahrnutých v optimální opční kombinaci. Další práce v této oblasti by se tedy měla zaměřit na obecnější formulaci optimalizačního problému tak, aby bylo možno využít sofistikovanějších metod optimalizace.

Formální zpracování práce je přijatelné úrovní, práce neobsahuje nepřiměřený počet formálních chyb a překlepů. Zdá se, že obrázek na straně 62 je totožný s obrázkem na straně 51.

Student se vybranému tématu věnoval velmi intenzivně, v závěrečných částech práce zaměřených na hledání vhodné kombinované strategie však bylo třeba podstatnějších zásahů do navrhovaného algoritmu i textu práce.

Dotazy k diskuzi

1. V práci je pro „načítání“ dat použita funkce StockQuoteQuery. Jedná se o standardní funkci nebo o funkci z některého specializovaného Toolboxu programu Matlab ?

Navrhuj hodnocení známkou:

VELMI DOBRĚ

Datum, jméno a podpis:

3.6.2016

