

# Posudek práce

předložené na Ústavu aplikované informatiky Přírodovědecké fakulty JU

- |   |   |
|---|---|
| <input checked="" type="checkbox"/> posudek vedoucího | <input type="checkbox"/> posudek oponenta |
| <input checked="" type="checkbox"/> bakalářské práce  | <input type="checkbox"/> diplomové práce  |

**Autor/ka: Martin Krupička**

Název práce: Modelování a simulace obchodních strategií na finančním trhu

Studijní obor: Aplikovaná informatika

Datum odevzdání: 13. 12. 2013

**Jméno a tituly vedoucího/opponenta: Ing. Jiří Jelínek, CSc.**

Pracoviště: Ústav aplikované informatiky

Kontaktní e-mail: jjelinek@prf.jcu.cz

**Odborná úroveň práce:**

- vynikající  velmi dobrá  průměrná  podprůměrná  nevyhovující

**Věcné chyby:**

- téměř žádné  vzhledem k rozsahu přiměřený počet  méně podstatné četné  závažné

**Výsledky:**

- originální  původní i převzaté  netriviální kompilace  citované z literatury  opsané

**Rozsah práce:**

- veliký  standardní  dostatečný  nedostatečný

**Grafická, jazyková a formální úroveň:**

- vynikající  velmi dobrá  průměrná  podprůměrná  nevyhovující

**Tiskové chyby:**

- téměř žádné  vzhledem k rozsahu a tématu přiměřený počet  četné

**Celková úroveň práce:**

- vynikající  velmi dobrá  průměrná  podprůměrná  nevyhovující

**Slovní vyjádření, komentáře a připomínky vedoucího/oponenta:**

Autor se ve své práci zabýval aplikací technik agentního modelování a simulací na oblast finančních trhů, což je nepříliš časté téma s významným potenciálem.

V první části práce jsou podrobně popsány mechanismy fungování finančních trhů s důrazem na finanční deriváty. Autor dále popisuje obchodní strategie a způsob jejich volby na základě různých forem analýzy trhu. V celé teoretické části je citována řada informačních zdrojů.

V další kapitole je krátce představen řešený problém (nastavení vhodné obchodní strategie) a autorem navržený konceptuální model. Zejména v této části vidím hlavní vklad autora. Pro implementaci modelu a simulace s ním si autor zajistil i reálná historická data.

S dvoustupňovým modelem autor provedl tři experimenty, které ukázaly, že navržená metodika a model mohou sloužit pro efektivní nastavení obchodní strategie na základě fundamentální analýzy burzovních dat (s limity, které tato cesta má). I zde je jasně patrný aktivní a samostatný přístup autora k tvorbě práce. Některé grafy výstupů experimentů by mohly být upraveny pro docílení vyšší vypovídací schopnosti.

Přílohy práce obsahují detailní informace o provedených experimentech a na přiloženém CD je i kompletní funkční model.

Práce je na dobré grafické úrovni s drobnými nedostatky (u uvedených vzorců se obvykle nezobrazuje rámeček tabulky) a je z ní patrný výrazný osobní vklad autora a jeho schopnost prakticky použít znalosti ze dvou základních oblastí (modelování a finanční trhy). V průběhu tvorby práce autor pracoval převážně samostatně a respektoval připomínky vedoucího.

**Případné otázky při obhajobě a náměty do diskuze:**

1. Jaké potenciální vylepšení vašeho modelu byste nyní (po vytvoření celé práce) navrhl?
2. Jak obtížné by bylo celý model nasadit do reálné praxe?

**Práci**

doporučuji

nedoporučuji

uznat jako diplomovou/bakalářskou.

**Navrhuji hodnocení stupněm:**

výborně  velmi dobře  dobře  neprospěl/a

Místo, datum a podpis vedoucího/oponenta: České Budějovice, 13. 1. 2014

