

Posudek vedoucího bakalářské práce

Autor práce (jméno a příjmení)	Josef SUCHÝ
Název práce	Tvorba portfolia na burze cenných papírů
Název a typ studijního programu	Ekonomika a management / Bakalářský
Fakulta / katedra	Ekonomická fakulta / KUF
Vedoucí práce	Kopta Daniel, Ing. Ph.D.
Autor posudku	Ing. Daniel Kopta Ph.D.

Hodnocení práce

1. Logická struktura práce 1.5
2. Naplnění cíle práce 1.5
3. Metodický postup 1.5
4. Hodnocení teoretického a/nebo praktického přínosu práce 2.5

Poznámka: Přínos práce je spíše teoretický, z práce jsou patrné efekty diverzifikace. Praktická využitelnost práce pro potenciálního investora je nízká. To je zřejmé i z dosažených výnosů.

5. Práce s literaturou 1.5
6. Formální stránka 2.0

Poznámka: Stylistická a gramatická úroveň práce je spíše nižší.

7. Vlastní přínos studenta k řešení problematice 1.5
8. Kontrola plagiátorství (výsledek) **negativní**

Závěr

Hodnocení práce známkou: **velmi dobře**

Doporučuji práci k obhajobě: **ANO**

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce

Práce vychází z promyšlené metodiky. Dílčí výsledné hodnoty však často neodpovídaly původním představám, autor však obvykle pokračoval v původně zamýšlené metodice. Z tohoto důvodu se jeví sporná například tvorba redukováného neutrálního portfolia, které obsahuje jen o málo akcií méně, než původně vytvořené velké portfolio a původně zamýšlené pozitivní efekty redukce portfolia tak nejsou příliš výrazné.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Nevýhodou Sharpeova poměru je, že nebere v úvahu asymetričnost rizika. Zároveň se růst akcie projevuje nárůstem volatility. Jaké jsou možné alternativy tohoto ukazatele.

Datum: 08.05.2017

Podpis vedoucího bakalářské práce