

Posudek vedoucího bakalářské práce

Jméno a příjmení studenta	Viet Hung TRAN
Název práce	Diverzifikace portfolia
Název a typ studijního programu	Ekonomika a management / Bakalářský
Fakulta / katedra	Ekonomická fakulta / KUF
Vedoucí práce	Zeman Petr, Ing. Ph.D.
Autor posudku	Ing. Petr Zeman Ph.D.

Posudek závěrečné práce

1. Logická struktura práce 1.5
2. Naplnění cíle práce 2.5
3. Metodický postup 2.5
4. Hodnocení teoretického a/nebo praktického přínosu práce 2.0
5. Práce s literaturou 2.0
6. Formální stránka 2.0
7. Vlastní přínos studenta k řešené problematice 2.0
8. Kontrola plagiátorství (výsledek) **negativní**

Závěr

Hodnocení práce (známka): **velmi dobře**

Doporučuji práci k obhajobě: **ANO**

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce

Předkládaná bakalářská práce splňuje jak věcné tak i rozsahové požadavky, které jsou kladeny na tento typ práce. Předkládaná práce má logickou strukturu a všechny důležité pojmy související s tématem byly vysvětleny srozumitelnou formou. V teoretické části práce bych autorovi vytkl pouze dlouhé citace, které snižují čtivost textu. V praktické části mám výhrady k výpočtu hraničních hodnot efektivní hranice, které jsou dle mého názoru špatně. Tyto body, stejně jako celá efektivní množina, by měly ležet v množině přípustných portfolií, což neleží. Jelikož výnos portfolia je počítán jako vážený průměr výnosností investic v portfoliu, existuje pouze jedno portfolio které nabízí maximální výnos a to je složené ze 100 % akcií PAM. Spodní hranice efektivní množiny je také vypočtena špatně, jelikož z tab. 7 plyne, že existují i portfolia, které nabízí nižší míru rizika než portfolio 28. Kromě této chyby jsem v práci nenašel jiné výraznější nedostatky a domnívám se, že cíl práce byl alespoň částečně splněn.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Přepočítejte a znovu určete efektivní hranici z Vámi určené přípustné množiny portfolií.

Datum: 02.05.2019

Podpis vedoucího práce