

Posudek vedoucího bakalářské práce

Jméno a příjmení studenta	Klára KOVANDOVÁ
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 1.0
2. Naplnění cíle práce 1.0
3. Metodický postup 1.0
4. Hodnocení teoretického a/nebo praktického přínosu práce 1.5
5. Práce s literaturou 1.5
6. Formální stránka 2.0
7. Vlastní přínos studenta k řešené problematice 1.5
8. Kontrola plagiátorství (výsledek) **negativní**

Závěr

Hodnocení práce (známka): **výborně**
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. Teoretická část práce má logickou strukturu, jednotlivé kapitoly na sebe navazují a uvedené citace jsou vhodně zapracovány do textu práce. Metodická část obsahuje všechna relevantní data a postupy, které jsou nutné pro zpracování praktické části práce. V praktické části autorka vypočetla výnosnosti a rizika vybraných akciových titulů, ze kterých následně sestavila portfolio a stanovila efektivní hranici portfolia, čímž splnila cíl práce. Práci bych vytkl pouze některé formální nedostatky (různé značení proměnných ve vzorcích, rozsáhlé tabulky v textu, drobné překlepy). Na druhou stranu ale oceňuji samostatnost studentky při zpracování práce.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Co si myslíte o stabilitě Vámi vypočtených korelačních koeficientů v čase? Zůstávají korelační koeficienty neměnné jak v časech růstu, tak v průběhu finanční krize? Jak se na hodnotách korelačních koeficientů u Vámi vybraných akcií projevila současná koronavirová krize?