

# Posudek vedoucího bakalářské práce

<b>Jméno a příjmení studenta</b>	Oldřich ČERNÝ
<b>Název práce</b>	Diverzifikace portfolia
<b>Název a typ studijního programu</b>	Systémové inženýrství a informatika / Bakalářský
<b>Fakulta / katedra</b>	Ekonomická fakulta / KUF
<b>Vedoucí práce</b>	Zeman Petr, Ing. Ph.D.
<b>Autor posudku</b>	Ing. Petr Zeman Ph.D.

## Posudek závěrečné práce

1. Logická struktura práce 2.0
2. Naplnění cíle práce 2.0
3. Metodický postup 1.5
4. Hodnocení teoretického a/nebo praktického přínosu práce 2.0
5. Práce s literaturou 2.5
6. Formální stránka 3.0
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

Autor vypracoval bakalářskou práci na téma Diverzifikace portfolia, která splňuje věcně i rozsahově požadavky, které jsou na tento typ práce kladeny. V teoretické část má logickou strukturu, ovšem zde uváděné citace nejsou vhodně zapracovány do textu práce, který je místy nesouvislý a obsahuje některé nepřesné formulace a definice. Navíc zde postrádám kapitolu věnovanou výběru optimálního portfolia investorem. V metodické části jsou popsány všechny postupy, které jsou nutné pro zpracování aplikační části práce. V praktické části pak autor modeluje efektivní množinu portfolií z vybraných akcií, čímž splnil cíl práce. Autorovi bych vytkl také nedostatky týkající se formální stránky práce, jako např. špatně zarovnaný text nebo různé formáty tabulek.

### Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Co si myslíte o stabilitě Vámi vypočtených korelačních koeficientů v čase? Vykazují korelační koeficienty stejné hodnoty v období růstu i poklesu? Ovlivnila současná koronavirová krize hodnoty Vámi vypočtených korelačních koeficientů?