



Posudek oponenta diplomové práce

Autor (jméno, příjmení): Rudolf, Kalkus

Název diplomové práce: Optimalizace vybrané obchodní strategie na měnovém trhu FOREX

Studijní obor: Řízení a ekonomika podniku

Fakulta/katedra: Ekonomická fakulta, Katedra účetnictví a financí

Oponent diplomové práce: Filip, Fyrbach, ING

Obor profesního působení: Finance

Hodnocení práce

1. **Význam a náročnost tématu:** 100 %
2. **Logická struktura práce:** 75 %
3. **Naplnění cíle práce:** 75 %
4. **Metodologický postup:** 75 %
5. **Hodnocení teoretického zobecnění a přínosu:** 75 %
6. **Praktický přínos práce:** 75 %
7. **Práce s literaturou:** 100 %
8. **Formální stránka:** 75 %

Závěr

Výsledek: 80 bodů

Návrh hodnocení práce známkou: výborně

Doporučuji práci k obhajobě: ANO

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce:

Autorovi se nedá upřít vysoký motivační přínos. Přílišná orientace na ziskové parametry optimalizovaného systému, ale částečně zastiňuje objektivitu a určitý nadhled, který by umožnil rozebrat zpracovávanou problematiku z více úhlů pohledu. Především absence komentářů k rizikovým charakteristikám výsledků strategie (bez ohledu na to do jaké míry je i vnímání rizika subjektivní záležitostí) celou práci částečně znehodnocuje.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí:

Autor nabízí v práci vysvětlení, proč se mu v paper tradingu vedlo diametrálně odlišně, než jak bylo nastaveno očekávání dle provedených back testů. Jakým způsobem sladit volbu signálů v backtestu a v papertradingu, či reálném obchodování tak, aby vstupy byly co nejpodobnější a tím dosažené výsledky co možná nejlepší?

Datum: 07. 05. 2012



Podpis oponenta diplomové práce: