

Posudek vedoucího bakalářské práce

Autor práce (jméno a příjmení)	Vladislav BUREŠ
Název práce	Psychologická analýza a řízení rizika při obchodování na kapitálových trzích
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.

Hodnocení práce

1. Význam a náročnost tématu **100 %**
2. Logická struktura práce **75 %**
3. Naplnění cíle práce **100 %**
4. Metodologický postup **100 %**
5. Hodnocení teoretického zobecnění a přínosu **75 %**
6. Praktický přínos práce **75 %**
7. Práce s literaturou **100 %**
8. Formální stránka **100 %**
9. Samostatnost studenta **75 %**
10. Kontrola plagiátorství (výsledek) **negativní**

Závěr

Výsledek: **90.0** bodů

Hodnocení práce známkou: **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 aplikační části práce. Zde lze práci vytknout absenci konkrétních testovaných hypotéz, které by přispěly ke zvýšení přehlednosti práce. V aplikační části autor vytvořil dvě obchodní strategie, které využívají prvky psychologické a technické analýzy. Obě strategie jsou doplněny variantami, které obsahují prvky-risk managementu. Autor zde jednak porovnal výnosnost jednotlivých strategií s výnosností trhu, a jednak posoudil vliv chytrých příkazů na výnosnost zvolených strategií, čímž splnil cíl práce. Autorovi bych zde vytkl nepřehledné značení zvolených strategií, což opět snižuje čtenářovu orientaci v textu.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

Při porovnání rozptylů výnosností vytvořených strategií a pasívní strategie jste došel k závěru, že rozptyly výnosností těchto strategií jsou různé (tabulka 7,8,10). Čím je tento jev způsoben?

Co tvrdí zákon velkých čísel a proč ho nelze využít v investiční strategii?

Datum: 13.05.2014

Podpis vedoucího bakalářské
práce