

Posudek oponenta bakalářské práce

Jméno a příjmení studenta	Angelina YUMATOVA
Název práce	Data mining pro efektivní ocenění a ovládání akciového portfolia
Název a typ studijního programu	Systémové inženýrství a informatika / Bakalářský
Fakulta / katedra	Ekonomická fakulta / KMI
Vedoucí práce	Cepák Milan, Ing. Ph.D.
Oponent	Ing. Juraj Bohuš

Posudek závěrečné práce

1. Význam a náročnost tématu 1.0

Poznámka: Zvolené téma je vysoce aktuální jak z hlediska ekonomického (vysoká inflace), tak z hlediska aplikované informatiky. Numerická analýza je vhodným nástrojem pro výběr akcií do optimálního investičního portfolia.

2. Logická struktura práce 2.0

Poznámka: Práce je z celkového pohledu strukturována přehledně a ve výkladu základních pojmů se postupovalo správně, ale v jednotlivých kapitolách a odstavcích doporučuji používat strukturovanější zápis.

3. Naplnění cíle práce 2.5

Poznámka: Cíle práce byly splněny, ale předložené ukazatele a metody byly ověřeny pouze na minimálním vzorku 3-4 akcií. Doporučuji jejich ověření pomocí "backtestu" (test na historických datech) na větším počtu akcií.

4. Metodický postup 2.5

Poznámka: Předložené postupy pro hodnocení akcií firem byly metodicky správně vysvětleny, ale jejich aplikace na omezený počet akcií nedává prostor pro celkové posouzení vhodnosti jednotlivých postupů.

5. Hodnocení teoretického zobecnění a přínosu 2.5

Poznámka: V oblasti zobecnění a přínosu je chyba ve formě závěru založeném na srovnání pouze jednoho akciového titulu a akciového fondu. Zobecňující závěr by měl být založen na zkoumání většího vzorku dat.

6. Praktický přínos práce 1.5

Poznámka: Práce dává možnost poznat výhody a nevýhody jednotlivých postupů a lze ji využít pro návrh akciových portfolií.

7. Práce s literaturou 1.5

Poznámka: Citace jsou správné a použitá literatura je aktuální.

8. Formální stránka 1.5

Poznámka: V grafech chybí popis názvů os a v tabulkách a grafech chybí jednotky popisovaných/zobrazovaných veličin.

Závěr

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

Doporučuji práci k obhajobě: **ANO**

Otázky pro diskusi a poznámky

Kritické poznámky a celkový přínos, celková hodnota práce

Výsledky práce jsou prezentovány na velmi malém vzorku dat, ačkoli prezentované numerické metody by mohly být použity k rychlému vyhodnocení velkého množství dat a ke škodě této práce není využita a prezentovaná hlavní výhoda automatizovaného zpracování velkého množství dat.

Prezentované postupy hodnocení akcií pomocí ekonomických ukazatelů společností byly metodologicky správně vysvětleny, ale jejich aplikace na velmi malém počtu akcií nedává prostor pro obecné zhodnocení vhodnosti toho či onoho z postupů.

Doporučuji provést "backtest" (test na historických datech) na větším počtu akcií, aby se ověřila vhodnost jednotlivých postupů a metod pro návrh vhodného akciového portfolia.

Otázky nebo témata pro diskusi před komisí

bez otázek

Datum: 28.04.2023

Podpis oponenta