

Posudek vedoucího na diplomovou práci:

Dvouúrovňové optimalizační modely a jejich využití v úlohách optimalizace portfolia
Bc. Lenka Goduřová

Tato práce se zabývá aplikací dvouúrovňových optimalizačních modelů v úlohách optimalizace portfolia. Po úvodu je první kapitola věnována klasickým formulacím mean-risk modelů a základům stochastické dominance. Ve druhé kapitole jsou představeny tři základní formulace dvouúrovňových úloh, ve kterých jsou používány různé mean-risk modely, či přístupy eficiency vzhledem ke stochastické dominanci druhého řádu. Třetí kapitola je věnována numerické studii, ve které autorka počítá optimální portfolia pro různé typy úloh.

Téma této práce považuji za velmi zajímavé, aktuální a přiměřeně náročné. Jedná se o druhou verzi této práce, kde autorka zapracovala připomínky oponenta a výrazně tak vylepšila přechozí verzi. Teď už práce dostatečně naplňuje předpoklady a požadavky kladené na diplomovou práci.

Diplomový úkol byl splněn.

Navrhuji uznat předloženou práci jako diplomovou.

V Praze 21.8.2018

doc. RNDr. Ing. Miloš Kopa, Ph.D.